9　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、ネッティング・セットを構成する取引において、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスク（特定の取引相手方に対する将来のエクスポージャーの額が、当該取引相手方のPDと高い相関を持って増減するリスクをいう。以下同じ。）が特定されたときは、当該取引を当該ネッティング・セットから除外するものとする。

10　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスクが特定された取引に係る信用リスク・アセットの額の算出においては、当該個別誤方向リスクの特性を勘案するものとする。

11　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、マージン・アグリーメントにより提供をし、又は提供を受ける担保が現金以外の資産を含むときは、当該担保の価格変動を適切に反映するものとする。

12　［略］

13　直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る金融商品取引法第二条第二十七項に規定する有価証券等清算取次ぎ、間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る商品先物取引法第二条第二十項に規定する商品清算取引その他間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る取次ぎ又はこれらに類する海外の取引を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーについては、第七項第一号の定めにかかわらず、同号に掲げるネッティング・セットのリスクのマージン期間を五営業日とすることができる。

（承認申請書の提出）

第五十九条の二　期待エクスポージャー方式の使用について前条第一項の承認を受けようとする商工組合中央金庫は、次に掲げる事項を記載した承認申請書を経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官に提出するものとする。

［一・二　略］

2　前項の承認申請書には、次に掲げる書類を添付するものとする。

［一～五　略］

3　前項第四号に掲げる期待エクスポージャー方式実施計画には、次に掲げる事項を記載するものとする。

［一・二　略］

（承認の基準）

第五十九条の三　経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について第五十九条第一項の承認をしようとするときは、次に掲げる基準に適合する期待エクスポージャー計測モデルが当該承認に先立って一年以上にわたって内部管理において運用されており、かつ、期待エクスポージャー方式の使用を開始する日以降において、内部管理に関する体制が当該基準に適合することが見込まれるかどうかを審査するものとする。

［一～三　略］

9　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、ネッティング・セットを構成する取引において、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスク（特定の取引相手方に対する将来のエクスポージャーの額が、当該取引相手方のPDと高い相関を持って増減するリスクをいう。以下同じ。）が特定された場合には、当該取引を当該ネッティング・セットから除外しなければならない。

10　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、取引相手方及び参照企業の間に法的な関係が存在し、かつ、個別誤方向リスクが特定された取引に係る信用リスク・アセットの額の算出においては、当該個別誤方向リスクの特性を勘案しなければならない。

11　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、マージン・アグリーメントにより提供をし、又は提供を受ける担保が現金以外の資産を含む場合には、当該担保の価格変動を適切に反映しなければならない。

12　［同左］

13　直接清算参加者として間接清算参加者の適格中央清算機関向けトレード・エクスポージャーに係る清算取次ぎ等を行うことにより生ずる間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーについては、第七項第一号の定めにかかわらず、同号に掲げるネッティング・セットのリスクのマージン期間を五営業日とすることができる。

（承認申請書の提出）

第五十九条の二　期待エクスポージャー方式の使用について前条第一項の承認を受けようとする商工組合中央金庫は、次に掲げる事項を記載した承認申請書を経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官に提出しなければならない。

［一・二　同左］

2　前項の承認申請書には、次に掲げる書類を添付しなければならない。

［一～五　同左］

3　前項第四号に掲げる期待エクスポージャー方式実施計画には、次に掲げる事項を記載しなければならない。

［一・二　同左］

（承認の基準）

第五十九条の三　経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官は、期待エクスポージャー方式の使用について第五十九条第一項の承認をしようとするときは、次に掲げる基準に適合する期待エクスポージャー計測モデルが当該承認に先立って一年以上にわたって内部管理において運用されており、かつ、期待エクスポージャー方式の使用を開始する日以降において、内部管理に関する体制が当該基準に適合することが見込まれるかどうかを審査しなければならない。

［一～三　同左］