四　期待エクスポージャー計測モデルが、当該モデルの開発から独立し、かつ、十分な能力を有する者により、開発時点及びその後定期的に、かつ、期待エクスポージャー計測モデルへの重要な変更、市場の構造的な変化又はポートフォリオ構成の大きな変化によって期待エクスポージャー計測モデルの正確性が失われるおそれが生じた場合に検証されており、かつ、当該モデルが適切に見直されるための体制を整備していること。この場合において、当該検証は次に掲げる事項を含むものとする。

［イ～ハ　略］

［五～十四　略］

（変更に係る届出）

第五十九条の四　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、次の各号のいずれかに該当するときは、遅滞なく、その旨及びその内容を経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官に届け出るものとする。

［一～三　略］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、商工組合中央金庫が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出と併せて、又はその後速やかに提出するものとする。

（段階的適用等）

第五十九条の六　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、全ての派生商品取引又は全てのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用するものとする。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第五十九条の二第二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定めている場合は、この限りでない。

2　［略］

第七十五条　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫が標準的ボラティリティ調整率を用いる場合において、包括的手法の計算の対象とする取引について毎営業日の時価評価又は担保額調整を行っており、かつ、保有期間（ボラティリティ調整率を計算する際に、当該資産を保有すると仮定する期間をいう。以下この目から第四目までにおいて同じ。）が十営業日のときに用いるボラティリティ調整率は、次の各号に掲げる場合において、当該各号に定めるものとする。

一　［略］

二　ボラティリティ調整率を適用する対象である資産が次の表に掲げる資産種別に該当する場合　その該当する資産種別に応じて、同表の右欄に定めるボラティリティ調整率

資産種別	ボラティリティ調整率
［略］	
適格金融資産担保以外の資産（当該資産について第五十五条第一項第八号に定める与信相当額を算出する場合、ＳＡ－ＣＣＲを用いて派生商品取引若しくは長期決済期間取引に係る与信相当額を算出する場合においてこれら	二十五パーセント

四　期待エクスポージャー計測モデルが、当該モデルの開発から独立し、かつ、十分な能力を有する者により、開発時点及びその後定期的に、かつ、期待エクスポージャー計測モデルへの重要な変更、市場の構造的な変化又はポートフォリオ構成の大きな変化によって期待エクスポージャー計測モデルの正確性が失われるおそれが生じた場合に検証されており、かつ、当該モデルが適切に見直されるための体制を整備していること。この場合において、当該検証は次に掲げる事項を含まなければならない。

［イ～ハ　同左］

［五～十四　同左］

（変更に係る届出）

第五十九条の四　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、次の各号のいずれかに該当する場合は、遅滞なく、その旨及びその内容を経済産業大臣、財務大臣及び金融庁長官に届け出なければならない。

［一～三　同左］

2　前項第三号に基づく届出を行う場合には、標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、商工組合中央金庫が承認の基準を満たさない事項に関する改善計画を当該届出とあわせて、又はその後速やかに提出しなければならない。

（段階的適用等）

第五十九条の六　期待エクスポージャー方式の使用について承認を受けた標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫は、すべての派生商品取引又はすべてのレポ形式の取引について期待エクスポージャー方式を適用しなければならない。ただし、期待エクスポージャー方式の適用を開始した後の一定の期間について、一部の取引の与信相当額について期待エクスポージャー方式を適用しない旨を第五十九条の二第二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定めている場合は、この限りでない。

2　［同左］

第七十五条　［同左］

一　［同左］

二　ボラティリティ調整率を適用する対象である資産が次の表に掲げる資産種別に該当する場合　その該当する資産種別に応じて、同表の右欄に定めるボラティリティ調整率

資産種別	ボラティリティ調整率
［同左］	
適格金融資産担保以外の資産（当該資産について第五十五条第一項第八号に定める与信相当額を算出する場合又は第七十一条ただし書の定めるところによりレポ形式の取引について第七十条各号及び第七十一条各号に掲げる	二十五パーセント