の取引に係る与信相当額が算出される担保の提供に用いるとき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もの以外の資産を用いる場合に限る。以下同じ。）	

2　［略］

第八目　削除

第九十四条　削除

（二十パーセント・フロアの適用除外）

第九十七条　適格金融資産担保付取引が次に掲げるものである場合には、前条の規定にかかわらず、当該各号に定めるリスク・ウェイトを適用することができる。

［一・二　略］

［号を削る。］

［号を削る。］

三　［略］

［節を削る。］

もの以外の資産を用いる場合に限る。以下同じ。）	

2　［同左］

第八目　包括的手法における担保付派生商品取引

（計算方法）

第九十四条　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫が包括的手法を適用する場合であって、先渡、スワップ及びオプション等の派生商品取引についてカレント・エクスポージャー方式を使用し、かつ、適格金融資産担保を用いるときのエクスポージャーの額は、次の式により算出する。

$E^* = (RC + アドオン) - C_A$

E^*は、信用リスク削減手法適用後エクスポージャー額（ただし、零を下回らない値とする。）

RCは、第五十七条第二項第一号に定める再構築コスト

アドオンは、同条第三項第一号に定めるグロスのアドオン

C_Aは、H_c（適格金融資産担保に適用するボラティリティ調整率）及びHf_x（エクスポージャーと適格金融資産担保の通貨が異なる場合に適用するボラティリティ調整率）を適用した後の担保額

2　法的に有効な相対ネッティング契約が存在する場合は、前項のRCは第五十七条第二項第二号に定めるネット再構築コストとし、また、アドオンは同条第三項第二号に定めるネットのアドオンとする。

3　前項に規定する場合において、第一項のHf_xは、当該相対ネッティングが行われる場合の決済通貨と金融資産担保の通貨が異なるときに適用するものとする。

（二十パーセント・フロアの適用除外）

第九十七条　［同左］

［一・二　同左］

三　派生商品取引に係るエクスポージャー（カレント・エクスポージャー方式を使用する場合に限る。）と担保が同一の通貨建てであり、かつ、標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫が毎営業日に時価評価を行っている場合において、現金又は自金庫預金が担保であるとき。　零パーセント

四　前号に規定する場合において、中央政府等又は我が国の地方公共団体の発行する債券が担保であり、かつ、当該債券の標準的手法におけるリスク・ウェイトが零パーセントのとき。　十パーセント

五　［同左］

第七節　間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例