第百三十三条　内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫の信用リスク・アセットの額の合計額とは、次に掲げる額の合計額をいう。

一　［略］

二　内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫が標準的手法を適用する部分につき、第二十五条（第一号に係る部分に限る。）の規定を準用することにより標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額の合計額。この場合において、同項中「標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫」とあるのは「内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫」と読み替えるものとする。

三　［略］

四　第六章の三に定めるところにより算出した第二十五条第三号に規定する中央清算機関関連エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百三十九条　［略］

［２～５　略］

［項を削る。］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十七条　［略］

［２～５　略］

（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）

第百二十条の二　標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫が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に対するトレード・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、与信相当額の算出に第五十九条に定める期待エクスポージャー方式を用いていない場合には、当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額は、次の算式により算出した額を当該信用リスク・アセットの額とみなすことができる。

RWA*＝RWA×$\sqrt{}$（Tm／10）

RWA*は、この条の規定の適用後の信用リスク・アセットの額

RWAは、第一節から前節までの規定により算出した当該トレード・エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

Tmは、第五十九条第七項の定めに従い算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号の規定にかかわらず、日々の値洗いにより担保額が調整されるネッティング・セットに係るリスクのマージン期間は五営業日とすることができる。

第百三十三条　［同左］

一　［同左］

二　内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫が標準的手法を適用する部分につき、第二十五条第一項（第一号に係る部分に限る。）の規定を準用することにより標準的手法により算出した信用リスク・アセットの額の合計額。この場合において、同項中「標準的手法を採用した場合の商工組合中央金庫」とあるのは「内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫」と読み替えるものとする。

三　［同左］

四　第六章の三に定めるところにより算出した第二十五条第一項第三号に規定する中央清算機関関連エクスポージャーに係る信用リスク・アセットの額

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百三十九条　［同左］

［２～５　同左］

6　内部格付手法を採用した場合の商工組合中央金庫が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・エクスポージャーのEADを算出する場合であって、当該EADの算出に当たって第五十九条に定める期待エクスポージャー方式を用いていないときには、前各項の規定により算出したEAD（当該エクスポージャーに係るものに限る。）に次の掛目を乗じた額を当該間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーのEADとすることができる。

掛目＝$\sqrt{}$（Tm／10）

Tmは、第五十九条第七項の規定を準用して算出したリスクのマージン期間。この場合において、同項第一号中「ネッティング・セット　二十営業日」とあり、及び「ネッティング・セット　十営業日」とあるのは、「ネッティング・セット　五営業日」と読み替えるものとする。

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十七条　［同左］

［２～５　同左］