4　CCFは、次の各号に定めるものとする。

一　負債性商品以外のものを原資産とする場合、CCFは、その原資産の種類に応じ、それぞれ左欄に掲げる掛目とする。

原資産	金	株式	貴金属（金を除く。）	電力	コモディティ（貴金属及び電力を除く。）
掛目（パーセント）	五	七	八・五	四	十

二　負債性商品を原資産とする場合、CCFは、その原資産の種類に応じ、それぞれ左欄に掲げる掛目とする。

原資産	個別リスクの高い負債性商品	個別リスクの低い負債性商品（クレジット・デフォルト・スワップに係るリスク・ポジションに限る。）	その他
掛目（パーセント）	〇・六	〇・三	〇・二

三　外国為替に関するCCFは、二・五パーセントとする。

四　前三号に該当しないものの場合、CCFは十パーセントとする。

（期待エクスポージャー方式）

第五十三条　［同上］

2　［同上］

3　標準的手法採用金庫は、前項第一号に掲げる与信相当額の算出に当たっては、ポートフォリオごとに、現在の市場データを用いて算出した実効EPE又は適切なストレス期間を含むデータを用いて算出した実効EPEのうち、所要自己資本が大きくなるものを用いなければならない。

4　［同上］

5　標準的手法採用金庫は、ネッティング・セットに係る取引相手方に対するマージン・アグリーメント（当該取引相手方に係るエクスポージャーの額が指定された額を超えたときに、当該取引相手方に対して担保の提供を求めることができる旨の契約をいう。以下この条において同じ。）に基づき、期待エクスポージャー計測モデル（期待エクスポージャーを計測するモデルをいう。以下同じ。）において当該担保による効果を反映している場合には、第二項第三号に規定する実効EE_{ik}の算出において、当該担保による効果を勘案したEE_{ik}を用いることにより同項第二号に規定する実効EPEを計測する方法を使用することができる。ただし、取引相手方の信用状態が悪化した時に当該取引相手方に担保の提供を求めることができるものとされているマージン・アグリーメントに基づく担保による効果は反映してはならない。

（期待エクスポージャー方式）

第五十二条　［略］

2　［略］

3　標準的手法採用金庫は、前項第一号に掲げる与信相当額の算出に当たっては、ポートフォリオごとに、現在の市場データを用いて算出した実効EPE又は適切なストレス期間を含むデータを用いて算出した実効EPEのうち、所要自己資本が大きくなるものを用いるものとする。

4　［略］

5　標準的手法採用金庫は、ネッティング・セットに係る取引相手方に対するマージン・アグリーメントに基づき、期待エクスポージャー計測モデル（期待エクスポージャーを計測するモデルをいう。以下同じ。）において当該担保による効果を反映している場合には、第二項第三号に規定する実効EE_{ik}の算出において、当該担保による効果を勘案したEE_{ik}を用いることにより同項第二号に規定する実効EPEを計測する方法を使用することができる。ただし、取引相手方の信用状態が悪化した時に当該取引相手方に担保の提供を求めることができるものとされているマージン・アグリーメントに基づく担保による効果は反映しないものとする。