（計算方法）

第八十八条　標準的手法採用金庫が包括的手法を適用する場合であって、第五十条第二項の規定により先渡、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、第五十三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、Hc（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Hfx（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は第五十三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　［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）

第百十三条の二　標準的手法採用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カレント・エクスポージャー方式を用いている場合には、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。

$RWA^* = RWA \times \sqrt{}$（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、第五十三条第七項の規定により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。

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百三十二条　［略］

［2～4　略］

5　第五十条（第二項及び第三項を除く。）から第五十二条の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、これらの規定中「標準的手法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と、第五十条第四項中「前三項」とあるのは「第一項」と読み替えるものとする。

［項を削る。］

（計算方法）

第八十八条　標準的手法採用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、第五十一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、Hc（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Hfx（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は第五十一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　［同上］

（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）

第百十三条の二　標準的手法採用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五十三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。

$RWA^* = RWA \times \sqrt{}$（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、第五十三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。

（事業法人等向けエクスポージャーのEAD）

第百三十二条　［同上］

［2～4　同上］

5　第五十条から第五十三条の六までの規定は、事業法人等向けエクスポージャーのEADについて準用する。この場合において、「標準的手法採用金庫」とあるのは「内部格付手法採用金庫」と読み替えるものとする。

6　内部格付手法採用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