（マチュリティ）

第百三十三条　［略］

［2～5　略］

6　内部格付手法採用金庫が事業法人等向けエクスポージャーのEADについて第五十二条から第五十二条の六までの規定を準用する場合には、事業法人等向けエクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算式に用いるマチュリティは、第一号に掲げる算式により算出された実効マチュリティとし、同号に掲げる実効EE_{ik}は第二号に掲げる算式により算出された額とする。ただし、実効マチュリティが一年に満たない場合には一年とし、五年を超える場合には五年とする。

［一・二　略］

7　［略］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十条　［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、リテール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。］

（エクスポージャーの厚さ（T））

第二百三十六条　［略］

2　エクスポージャーの厚さを計算するに当たって、金利スワップ又は通貨スワップから生じるエクスポージャーの計算においては第五十条（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を準用する。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。

（CVAリスク相当額の算出）

第二百四十六条の二　［略］

2　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる金庫のいずれにも該当しない金庫にあっては、第三節に定める簡便的リスク測定方式を用いて、同項各号に掲げる者以外の者を取引相手方とする派生商品取引に係るCVAリスク相当額を算出することができる。

［一・二　略］

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、第五十三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。

（マチュリティ）

第百三十三条　［同上］

［2～5　同上］

6　内部格付手法採用金庫が事業法人等向けエクスポージャーのEADについて第五十三条から第五十三条の六までの規定を準用する場合には、事業法人等向けエクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算式に用いるマチュリティは、第一号に掲げる算式により算出された実効マチュリティとし、同号に掲げる実効EE_{ik}は第二号に掲げる算式により算出された額とする。ただし、実効マチュリティが一年に満たない場合には一年とし、五年を超える場合には五年とする。

［一・二　同上］

7　［同上］

（リテール向けエクスポージャーのEAD）

第百四十条　［同上］

［2～4　同上］

5　第五十条から第五十三条までの規定は、リテール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‖　第百三十二条第六項の規定は、リテール向けエクスポージャーであって、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を算出する場合について準用する。

（エクスポージャーの厚さ（T））

第二百三十六条　［同上］

2　エクスポージャーの厚さを計算するに当たって、金利スワップ又は通貨スワップから生じるエクスポージャーの計算においては第五十条から第五十三条の六までの規定を準用する。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」とあるものとする。

（CVAリスク相当額の算出）

第二百四十六条の二　［同上］

2　［同上］

［一・二　同上］