［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「標準的手法採用組合」とあるのは「内部格付手法採用組合」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、次の各号に掲げる組合のいずれにも該当しない組合にあっては、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］

三　期待エクスポージャー方式の使用について第五十二条第一項（第百三十二条第五項又は第百四十条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けた組合

3　［略］

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百四十六条の三　［略］

［2・3　略］

4　第一項のEAD^{total}は、次の各号に掲げる場合の区分に応じ、当該各号に定める取引相手方に係るネッティング・セットごとに算出した額とする。

一　ＳＡ－ＣＣＲを用いる場合　第五十一条第一項に規定する与信相当額の割引現在価値

［号を削る。］

二　期待エクスポージャー方式を用いる場合　第五十二条第二項に規定する与信相当額

三　カレント・エクスポージャー方式を用いる場合　第四章第六節第三款に規定する包括的手法を使用する場合の信用リスク削減手法を適用した後のエクスポージャーの額の割引現在価値

5　第一項並びに前項第一号及び第三号の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出するものとする。

（割引現在価値）＝（想定元本額又は与信相当額）×（1－EXP（－0.05×M_x））／（0.05×M_x）

M_xは、対応するM、M^{hedge}又はM_{ind}

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、内部格付手法採用組合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、「標準的手法採用組合」とあるのは「内部格付手法採用組合」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　［同上］

2　［同上］

［一・二　同上］

三　期待エクスポージャー方式の使用について第五十三条第一項（第百三十二条第五項又は第百四十条第五項において準用する場合を含む。）の承認を受けた組合

3　［同上］

（標準的リスク測定方式によるＣＶＡリスク相当額）

第二百四十六条の三　［同上］

［2・3　同上］

4　［同上］

一　カレント・エクスポージャー方式を用いる場合　第四章第六節第三款に規定する包括的手法を使用する場合の信用リスク削減手法を適用した後のエクスポージャーの額の割引現在価値

二　標準方式を用いる場合　第五十二条に規定する与信相当額の割引現在価値

三　期待エクスポージャー方式を用いる場合　第五十三条第二項に規定する与信相当額

［号を加える。］

5　第一項並びに前項第一号及び第二号の割引現在価値は、次に掲げる算式により算出するものとする。

（割引現在価値）＝（想定元本額又は与信相当額）×（1－EXP（－0.05×M_x））／（0.05×M_x）

M_xは、対応するM、M^{hedge}又はM_{ind}