6　［略］

7　第四項第三号に掲げる場合において、第一項のEAD^{total}（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・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、同号に定める額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{total}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、同項中「前項」とあるのは「第二百四十六条の三第七項」と、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。

（中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百四十六条の六　第四章（第五十一条第四項第二号及び第三号を除く。）の規定は、中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について準用する。この場合において、同章（第五十条第二項及び第三項を除く。）の規定中「標準的手法採用組合」とあるのは「組合」と読み替えるものとする。

2　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する場合における当該トレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、二パーセントとする。

［一・二　略］

3　第一項の規定により第四章の規定を準用する場合（ＳＡ－ＣＣＲを用いる場合に限る。）において、適格中央清算機関が支払不能となり、当該適格中央清算機関から変動証拠金として受け入れることが予定されている担保に対する損失の発生を防ぐための方策が講じられていないときは、リスクのマージン期間は、ネッティング・セットに含まれる取引のMのうちの最も長い営業日数（十営業日を下回る場合には、十営業日とする。）と一年間の営業日数のうちいずれか短い営業日数とする。

4　第一項の規定により第四章の規定を準用する場合において、期待エクスポージャー方式を用いるときは、第五十二条第七項第一号中「イからニまで」とあるのは「イ、ロ又はニ」と、同号イ中「ロ又はハ」とあるのは「ロ」と、同号ニ中「イからハまで」とあるのは「イ又はロ」と読み替えるものとする。ただし、当該適格中央清算機関が支払不能となった場合において、当該適格中央清算機関から変動証拠金として受け入れることが予定されている担保に対する損失の発生を防ぐための方策が講じられていないときは、リスクのマージン期間は、ネッティング・セットに含まれる取引の残存期間のうちの最も長い営業日数（十営業日を下回る場合には、十営業日とする。）と一年間の営業日数のうちいずれか短い営業日数とする。

6　［同上］

7　第四項第一号又は第二号に掲げる場合において、第一項のEAD^{total}（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・エクスポージャーに係るものに限る。）を算出する場合には、第四項第一号又は第二号に定める額に次の掛目を乗じた額を、当該ネッティング・セットのEAD^{total}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。

（中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセット）

第二百四十六条の六　第四章の規定は、中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー及び直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について準用する。この場合において、「標準的手法採用組合」とあるのは「組合」と読み替えるものとする。

2　前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額を算出する場合、当該トレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、二パーセントとする。また、次の各号に掲げるトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出について前項の規定に基づき第四章の規定を準用する場合において、第五十三条第七項第一号中「イからニまで」とあるのは「イ、ロ又はニ」と、同号イ中「ロ又はハ」とあるのは「ロ」と、同号ニ中「イからハまで」とあるのは「イ又はロ」と、第七十五条第二項第一号ニ中「流動性の低い担保又は再構築の困難な派生商品取引を含むネッティング・セット及び算出基準日を含む四半期の一期前の四半期内のいずれかの時点で取引件数が五千件を超えたネッティング・セット」とあるのは「流動性の低い担保又は再構築の困難な派生商品取引を含むネッティング・セット」と読み替えるものとする。

［一・二　同上］

3　第一項の規定にかかわらず、直接清算参加者向けトレード・エクスポージャー（組合が間接清算参加者である場合において、直接清算参加者及び他の間接清算参加者が共に債務不履行又は支払不能となった場合に、組合への損失の発生を防ぐための方策を適格中央清算機関又は直接清算参加者が講じていない場合に限る。）の信用リスク・アセットの額を算出する場合、当該直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーのリスク・ウェイトは、四パーセントとする。

［項を加える。］