［項を削る。］

5・6　［略］

（適用除外）

第二百四十七条の五　［略］

2　第二百四十七条の二第二項に規定する場合において、期待エクスポージャー方式を用いないで与信相当額を算出する特定のポートフォリオに含まれる派生商品取引については、あらかじめ農林水産大臣及び金融庁長官に届け出た場合に限り、当該派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を前節に定める標準的リスク測定方式を用いて算出することができる。

（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）

第二百四十七条の七　第四章（第五十六条の二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、「農林中央金庫が標準的手法を採用した場合」とあるのは「農林中央金庫が標準的手法又は内部格付手法を採用した場合」と、第五十六条の四の四、第五十六条の四の五及び第五十六条の四の六第一項中「標準的手法を採用した農林中央金庫」とあるのは「農林中央金庫」と、第五十六条の四の六第二項中「標準的手法を採用し、期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」とあるのは「期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」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。

5　前項の規定にかかわらず、第五十六条の四第六項（第百三十四条第五項又は第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）に規定する方法を使用する場合には、ネッティング・セットにおける最も長いマチュリティの二分の一に相当する期間又は当該ネッティング・セットに含まれる全ての派生商品取引に係る想定元本額の名目額により加重平均したマチュリティのいずれか大きい期間をＥＥとし、当該ネッティング・セットの実効ＥＰＥをＥＥとしなければならない。

6・7　［同上］

（適用除外）

第二百四十七条の五　［同上］

2　カレント・エクスポージャー方式又は標準方式を用いて与信相当額を算出する特定のポートフォリオに含まれる派生商品取引については、あらかじめ農林水産大臣及び金融庁長官に届け出た場合に限り、当該派生商品取引に係るＣＶＡリスク相当額を前節に定める標準的リスク測定方式を用いて算出することができる。

（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）

第二百四十七条の七　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、「農林中央金庫が標準的手法を採用した場合」とあるのは「農林中央金庫が標準的手法又は内部格付手法を採用した場合」と、第五十六条の四の四、第五十六条の四の五及び第五十六条の四の六第一項中「標準的手法を採用した農林中央金庫」とあるのは「農林中央金庫」と、第五十六条の四の六第二項中「標準的手法を採用し、期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」とあるのは「期待エクスポージャー方式の承認を受けた農林中央金庫」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、第五十六条の四第七項第一号中「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、第七十七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（農林中央金庫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、農林中央金庫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。