M_iは、当該金利デリバティブiの残存期間をいい、当該金利デリバティブの原資産が金利デリバティブであり、かつ、当該原資産を受け渡すこととなっている場合にあっては、原資産である金利デリバティブの満期日と算出基準日の間の営業日数（十営業日未満であるときは、十営業日）をいう。

ロ　マージン・アグリーメントを締結している場合

$$\frac{3}{2}\times\sqrt{\frac{MPOR_i}{250}}$$

$MPOR_i$は、当該金利デリバティブiを含むネッティング・セットのリスクのマージン期間

第四項の規定は、前号ロのリスクのマージン期間の算出について準用する。この場合において、「前項第二号」とあるのは「第十一項第七号ロ」と読み替えるものとする。

九　第五項の規定は、担保額調整に係る係争がある場合における第七号ロのリスクのマージン期間の算出について準用する。この場合において、「前項の」とあるのは「第十一項第八号において読み替えて準用する前項の」と、「前項各号」とあるのは「第十一項第八号において読み替えて準用する前項各号」と読み替えるものとする。

十　第六項の算式中$AddOn^{(FX)}$は、次に掲げるところに従い、算出する。

一　算出に用いる算式は、次のとおりとする。

$$AddOn^{(FX)}=\sum_{j}AddOn^{(FX)}_{(HS)_j}$$

$AddOn^{(FX)}_{(HS)_j}$は、ヘッジセットjに係るアドオンの額

二　前号の算式中$AddOn^{(FX)}_{(HS)_j}$は、次の表の上欄に掲げるヘッジセットの区分に応じ、同表の下欄に定める掛目を当該ヘッジセットに係る実効想定元本額の絶対値に乗じて得た額とする。

ヘッジセットの区分	掛目（パーセント）
第八項各号に定めるヘッジセット	四
第十項に規定する別に設けられたヘッジセット	二十

三　前号に規定するヘッジセットに係る実効想定元本額は、ヘッジセットに含まれる外国為替デリバティブごとに、当該外国為替デリバティブに係る想定元本額にデルタ調整値及びマージン期間調整値を乗じて得た額の合計額とする。

四　前号のデルタ調整値は、次のイからハまでに掲げる取引の区分に応じ、当該イからハまでに定める値とする。ただし、同一の異種通貨間の為替レートを参照する外国為替デリバティブがネッティング・セットに複数含まれる場合には、為替レートの方向をそろえて、当該異種通貨間の為替レートの上昇及び下落を表すものとする。

イ　オプション　値の算出については、前項第六号（イに係る部分に限る。）の規定を準用する。この場合において、「第四号のデルタ調整値」とあるのは「次項第三号のデルタ調整値（同項第四号イに掲げる取引の区分に係るものに限る。）」と、「イからハまで」とあるのは「イ」と、「金利等」とあるのは「為替レート等」と、「σは、〇・五」とあるのは「σは、〇・一五」と読み替えるものとする。

ロ　イに掲げる取引以外の取引のうち、当該外国為替デリバティブが参照する為替レート等が上昇する場合に、当該外国為替デリバティブの時価が上昇するもの　一

ハ　イに掲げる取引以外の取引のうち、当該外国為替デリバティブが参照する為替レート等が上昇する場合に、当該外国為替デリバティブの時価が下落するもの　マイナス一