（標準的ボラティリティ調整率）

第九十四条　標準的手法採用行が標準的ボラティリティ調整率を用いる場合において、包括的手法の計算の対象とする取引について毎営業日の時価評価又は担保額調整を行っており、かつ、保有期間（ボラティリティ調整率を計算する際に、当該資産を保有すると仮定する期間をいう。以下この目から第四目までにおいて同じ。）が十営業日のときに用いるボラティリティ調整率は、次の各号に掲げる場合において、当該各号に定めるものとする。

一　［略］

二　ボラティリティ調整率を適用する対象である資産が次の表に掲げる資産種別に該当する場合　その該当する資産種別に応じて、同表の下欄に定めるボラティリティ調整率

資産種別	ボラティリティ調整率
［略］	
適格金融資産担保以外の資産（当該資産について第七十八条第一項第八号に定める与信相当額を算出する場合、SA－CCRを用いて派生商品取引若しくは長期決済期間取引に係る与信相当額を算出する場合においてこれらの取引に係る与信相当額が算出される担保の提供に用いるとき又は第九十条ただし書の定めるところによりレポ形式の取引について第八十九条各号及び第九十条各号に掲げるもの以外の資産を用いる場合に限る。以下同じ。）	二十五パーセント

2　［略］

（計算方法）

第百十三条　標準的手法採用行が包括的手法を適用する場合であって、第七十九条第二項の規定により先渡、スワップ及びオプション等の派生商品取引についてカレント・エクスポージャー方式を使用し、かつ、適格金融資産担保を用いるときのエクスポージャーの額は、次の式により算出する。

$$E^* = (RC + アドオン) - C_A$$

E^*は、信用リスク削減手法適用後エクスポージャー額（ただし、零を下回らない値とする。）

RCは、第七十九条の四第二項第一号に定める再構築コスト

アドオンは、同条第三項第一号に定めるグロスのアドオン

C_Aは、Hc（適格金融資産担保に適用するボラティリティ調整率）及びHfx（エクスポージャーと適格金融資産担保の通貨が異なる場合に適用するボラティリティ調整率）を適用した後の担保額

2　法的に有効な相対ネッティング契約が存在する場合は、前項のRCは第七十九条の四第二項第二号に定めるネット再構築コストとし、また、アドオンは同条第三項第二号に定めるネットのアドオンとする。

3　［略］

（間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例）

第百三十九条の二　標準的手法採用行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に対するトレード・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

（標準的ボラティリティ調整率）

第九十四条　［同上］

一　［同上］

二　ボラティリティ調整率を適用する対象である資産が次の表に掲げる資産種別に該当する場合　その該当する資産種別に応じて、同表の下欄に定めるボラティリティ調整率

資産種別	ボラティリティ調整率
［同上］	
適格金融資産担保以外の資産（当該資産について第七十八条第一項第八号に定める与信相当額を算出する場合又は第九十条ただし書の定めるところによりレポ形式の取引について第八十九条各号及び第九十条各号に掲げるもの以外の資産を用いる場合に限る。以下同じ。）	二十五パーセント

2　［同上］

（計算方法）

第百十三条　標準的手法採用行が包括的手法を適用する場合であって、先渡、スワップ及びオプション等の派生商品取引についてカレント・エクスポージャー方式を使用し、かつ、適格金融資産担保を用いるときのエクスポージャーの額は、次の式により算出する。

$$E^* = (RC + アドオン) - C_A$$

E^*は、信用リスク削減手法適用後エクスポージャー額（ただし、零を下回らない値とする。）

RCは、第七十九条の二第二項第一号に定める再構築コスト

アドオンは、同条第三項第一号に定めるグロスのアドオン

C_Aは、Hc（適格金融資産担保に適用するボラティリティ調整率）及びHfx（エクスポージャーと適格金融資産担保の通貨が異なる場合に適用するボラティリティ調整率）を適用した後の担保額

2　法的に有効な相対ネッティング契約が存在する場合は、前項のRCは第七十九条の二第二項第二号に定めるネット再構築コストとし、また、アドオンは同条第三項第二号に定めるネットのアドオンとする。

3　［同上］

（間接清算参加者に対するトレード・エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出方法の特例）

第百三十九条の二　標準的手法採用行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に対するトレード・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