二　次の算式により得られるネットのアドオンの額

ネットのアドオン＝0.4×グロスのアドオン
＋0.6×ネット再構築コスト／グロス再構築コスト×グロスのアドオン

（標準的ボラティリティ調整率）

第七十二条　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五十六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六十八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六十七条各号及び第六十八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）

第九十一条　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、第五十七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、第五十七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

（標準的ボラティリティ調整率）

第七十二条　［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五十六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六十八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六十七条各号及び第六十八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）

第九十一条　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、第五十七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