MAは、マージン・アグリーメント（以下この項及び次項において同じ。）

V_{NS}は、NSに含まれる取引の時価の合計額

C_{MA}は、MAの下におけるヘアカット調整後のネット担保額

$C_{MA,collect}$は、MAの下における取引相手方から受け入れた適格金融資産担保の額

$Hc_{MA,collect}$は、MAの下において、適格金融資産担保を受け入れる場合において適用するボラティリティ調整率

$Hfx_{MA,collect}$は、MAの下において、適格金融資産担保を受け入れる場合においてエクスポージャーと適格金融資産担保の通貨が異なるときに適用するボラティリティ調整率

$C_{MA,post}$は、MAの下における取引相手方へ差し入れた担保（取引相手方以外の第三者によって分別管理されており、かつ、取引相手方に係る倒産手続又は外国における倒産手続と同種類の手続に伴う当該担保に対する損失の発生を防ぐために必要な方策が講ぜられているものを除く。）の額

$Hc_{MA,post}$は、MAの下において、担保を差し入れる場合において取引相手方に引き渡した資産の種類に応じて適用するボラティリティ調整率

$Hfx_{MA,post}$は、MAの下において、担保を差し入れる場合においてエクスポージャーと担保の通貨が異なるときに適用するボラティリティ調整率

18　第十六項の規定により与信相当額を算出する場合において、PFEは、次の算式を用いて算出する。

$$PFE=\sum_{NS\in MA} PFE_{NS}^{unmargined}$$

$PFE_{NS}^{unmargined}$は、NSに係るPFEについて、第六項のPFEに係る算式を準用して算出した額。ただし、マージン・アグリーメントを締結していないものとして算出することとする。

［条を削る。］

（標準方式）

第七十五条　標準的手法採用金庫が標準方式を用いる場合は、ネッティング・セット（法的に有効な相対ネッティング契約下にある取引については当該取引の集合をいい、それ以外の取引については個別取引をいう。以下同じ。）ごとに、次の各号に従い与信相当額を算出する。ただし、通貨が異なる変動金利相互間の金利スワップについては与信相当額を算出することを要しない。

一　ネッティング・セットの与信相当額は、次に掲げる算式により算出した額とする。ただし、受入れ担保は正の符号、差入れ担保は負の符号をもつものとして扱う。

$$与信相当額=1.4\times\max\left(CMV-CMC;\sum_j\left|\sum_i RPT_{ij}-\sum_l RPC_{lj}\right|\times CCF_j\right)$$

CMVは、ネッティング・セットに含まれる取引（担保の受入れ及び差入れを除く。）の時価の合計額

CMCは、ネッティング・セットに含まれる担保（受入れ担保については適格金融資産担保に限る。以下この条において同じ。）の時価の合計額

RPT_{ij}は、ヘッジ・セット（次項に定める区分をいう。以下同じ。）jにおける取引iのリスク・ポジション（次号に定める額をいう。以下同じ。）

RPC_{lj}は、ヘッジ・セットjにおける担保lのリスク・ポジション

CCF_jは、ヘッジ・セットjに対する掛目