10　前二項の規定にかかわらず、ボラティリティを参照する取引については、第八項各号に掲げる取引の区分ごとに、同項各号に定めるヘッジセットと別に設けられたヘッジセットに当該取引を割り当てるものとする。

11　第六項の算式中$AddOn^{(IR)}$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。

$$AddOn^{(IR)}=\sum_{j}AddOn_{j}^{(IR)}$$

$AddOn_{j}^{(IR)}$は、通貨j建ての金利デリバティブのヘッジセットに係るアドオンの額の合計額

二　前号の算式中$AddOn_{j}^{(IR)}$は、次の表の左欄に掲げるヘッジセットの区分に応じ、同表の右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に乗じて得た額の合計額とする。

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	〇・五〇
第九項に規定するヘッジセット	〇・二五
第十項に規定する別に設けられたヘッジセット	二・五〇

三　前号に規定するヘッジセットに係る実効想定元本額を算出する場合には、次のイ又はロのいずれかの算式を用いて算出する。

イ　$\left[(D_{j1}^{(IR)})^2+(D_{j2}^{(IR)})^2+(D_{j3}^{(IR)})^2+1.4\times D_{j1}^{(IR)}\times D_{j2}^{(IR)}+1.4\times D_{j2}^{(IR)}\times D_{j3}^{(IR)}+0.6\times D_{j1}^{(IR)}\times D_{j3}^{(IR)}\right]^{\frac{1}{2}}$

$D_{j1}^{(IR)}$は、通貨j建てであり、かつ、E_i（第五号に規定するE_iをいう。以下この号において同じ。）が一年未満である金利デリバティブに係る実効想定元本額の合計額（ロにおいて同じ。）

$D_{j2}^{(IR)}$は、通貨j建てであり、かつ、E_iが一年以上五年以下である金利デリバティブに係る実効想定元本額の合計額（ロにおいて同じ。）

$D_{j3}^{(IR)}$は、通貨j建てであり、かつ、E_iが五年超である金利デリバティブに係る実効想定元本額の合計額（ロにおいて同じ。）

ロ　$|D_{j1}^{(IR)}|+|D_{j2}^{(IR)}|+|D_{j3}^{(IR)}|$

四　前号の算式中金利デリバティブに係る実効想定元本額は、当該金利デリバティブに係るデュレーション調整後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とする。

五　前号のデュレーション調整後想定元本額は、金利デリバティブに係る想定元本額に、次の算式により得られるデュレーション調整値を乗じて得た額とする。ただし、当該デュレーション調整値が十営業日を年換算した値未満となるときは、デュレーション調整値は十営業日を年換算した値とする。

$$デュレーション調整値=\frac{\exp(-0.05\times S_i)-\exp(-0.05\times E_i)}{0.05}$$

S_iは、同号の金利デリバティブiが参照する金利契約の計算期間の最も早い日と算出基準日の間の営業日数を年換算で表した値をいい、当該金利デリバティブの原資産が金利デリバティブ又は負債性商品の場合には、原資産である金利デリバティブが参照する金利等又は負債性商品の金利等の計算期間の開始日と算出基準日の間の営業日数を年換算で表した値をいう。ただし、既に当該金利等又は負債性商品の金利等の計算期間の開始日が経過している場合には、零とする。