$Hc_{MA,post}$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。

**第五十八条**　削除

（標準方式）

**第五十八条**　標準的手法を採用した場合の商工組合中央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持つものとして扱う。

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

二　リスク・ポジションは、次のイからハまでのいずれかの規定により算出する。ただし、いずれの規定によってもリスク・ポジションを算出することができない場合、カレント・エクスポージャー方式により個別取引ごとに与信相当額を算出しなければならない。

イ　負債性商品（債券及び貸出金を含む。）以外のものを原資産とする場合、次の算式によりリスク・ポジションを算出する。

$$リスク・ポジション=p_{ref}\times\frac{\partial v}{\partial p}$$

$p_{ref}$は、原資産の価格（外国通貨建ての場合には円換算の額）

vは、線形リスクを有する場合には原資産の時価、非線形リスクを有する派生商品取引の場合はその時価

pは、原資産の価格（vと同じ表示通貨による。）

ロ　負債性商品を原資産とする場合又は支払部分である場合（クレジット・デフォルト・スワップを除く。）、次の算式によりリスク・ポジションを算出する。ただし、残存期間等（残存期間又は次の金利更改日までの期間をいう。以下同じ。）が一年以下の支払部分は、金利リスクに関してリスク・ポジションを算出することを要しない。

$$リスク・ポジション=\frac{\partial v}{\partial r}$$