$AddOn^{(Equity)}$は、エクイティ・デリバティブに係るアドオン

$AddOn^{(Com)}$は、コモディティ・デリバティブに係るアドオン

7　前項の規定により第一項のPFEを算出する場合において、ネッティング・セットに含まれる取引は、次の各号に掲げる当該取引のリスク・ドライバー（当該取引の時価に影響を及ぼす主な要因をいう。以下この項において同じ。）に応じ、当該各号に定める取引に割り当てるものとする。ただし、当該取引が複数のリスク・ドライバーを有する場合には、当該各号に定める複数の取引に同時に割り当てることができる。

一　金利の変動等　金利デリバティブ

二　外国為替の変動等　外国為替デリバティブ

三　原債務者に係る信用状態の変動　信用デリバティブ

四　株価の変動等　エクイティ・デリバティブ

五　コモディティ価格の変動等その他前四号に掲げるリスク・ドライバー以外の変動等　コモディティ・デリバティブ

8　前項各号に定める取引に割り当てた取引は、次の各号に掲げる取引の区分に応じ、当該各号に定めるヘッジセットに割り当てるものとする。

一　金利デリバティブ　同一通貨の金利を参照する金利デリバティブごとに設けられたヘッジセット

二　外国為替デリバティブ　同一の異種通貨間の為替レートを参照する外国為替デリバティブごとに設けられたヘッジセット

三　信用デリバティブ　一の区分のヘッジセット

四　エクイティ・デリバティブ　一の区分のヘッジセット

五　コモディティ・デリバティブ　エネルギー、金属、農産物その他のコモディティ等を参照するコモディティ・デリバティブごとに設けられたヘッジセット

9　前項の規定にかかわらず、ベーシス（同一通貨の異なるリスク・ファクター（当該取引の時価に影響を及ぼす要因をいう。以下この項及び第五十二条の三において同じ。）間の差異をいう。）を参照する取引については、前項に掲げる取引の区分ごと及びリスク・ファクターの同一の組合せごと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。

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$AddOn_t^{(IR)}$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、次の表の上欄に掲げるヘッジセットの区分に応じ、同表の下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

二　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、次の算式により得られた額（ネットのアドオン）とすることができる。

$$ネットのアドオン=0.4\times グロスのアドオン+0.6\times \frac{ネット再構築コスト}{グロス再構築コスト}\times グロスのアドオン$$