コール・オプションの売り	$-\phi\left(\dfrac{\ln\left(P_i/K_i\right)+0.5\times\sigma_i^2\times T_i}{\sigma_i\times\sqrt{T_i}}\right)$
プット・オプションの買い	$-\phi\left(-\dfrac{\ln\left(P_i/K_i\right)+0.5\times\sigma_i^2\times T_i}{\sigma_i\times\sqrt{T_i}}\right)$
プット・オプションの売り	$\phi\left(-\dfrac{\ln\left(P_i/K_i\right)+0.5\times\sigma_i^2\times T_i}{\sigma_i\times\sqrt{T_i}}\right)$

（注1）　P_iは、当該オプションiが参照する金利等の水準

（注2）　K_iは、当該オプションiの行使価格

（注3）　σ_iは、〇・五

（注4）　T_iは、当該オプションiにおける最も遅い権利行使日と現時点の間の営業日数を年換算で表した値

（注5）　$\Phi(x)$は、標準正規分布の累積分布関数

（注6）　この表において「コール・オプション」とは、当該オプションが参照する金利等が上昇する場合に、当該オプションの時価が上昇するものをいう。

（注7）　この表において「プット・オプション」とは、当該オプションが参照する金利等が上昇する場合に、当該オプションの時価が下落するものをいう。

ロ　イに掲げる取引に該当しない金利デリバティブのうち、当該金利デリバティブが参照する金利等が上昇する場合に、当該金利デリバティブの時価が上昇するもの　－

ハ　イに掲げる取引に該当しない金利デリバティブのうち、当該金利デリバティブが参照する金利等が上昇する場合に、当該金利デリバティブの時価が下落するもの　マイナス一

七　第四号のマージン期間調整値は、次のイ又はロに掲げる場合の区分に応じ、当該イ又はロに定める算式を用いて算出する。

イ　マージン・アグリーメントを締結していない場合

$$\sqrt{\frac{\min\left\{M_i,\ 250\right\}}{250}}$$

M_iは、当該金利デリバティブiの残存期間をいい、当該金利デリバティブの原資産が金利デリバティブであり、かつ、当該原資産を受け渡すこととなっている場合にあっては、原資産である金利デリバティブの満期日と算出基準日の間の営業日数（十営業日未満であるときは、十営業日）をいう。

ロ　マージン・アグリーメントを締結している場合

$$\frac{3}{2}\times\sqrt{\frac{MPOR_i}{250}}$$

$MPOR_i$は、当該金利デリバティブiを含むネッティング・セットのリスクのマージン期間

八　第四項の規定は、前号ロのリスクのマージン期間の算出について準用する。この場合において、「前項第二号」とあるのは、「第十一項第七号ロ」と読み替えるものとする。

九　第五項の規定は、担保額調整に係る係争がある場合における第七号ロのリスクのマージン期間の算出について準用する。この場合において、「前項の」とあるのは「第十一項第八号において読み替えて準用する前項の」と、「前項各号」とあるのは「第十一項第八号において読み替えて準用する前項各号」と読み替えるものとする。