AddOn（Entity$_k$）は、Entity$_k$を参照する信用デリバティブに係るアドオンの額の合計額

Entity$_k$は、当該信用デリバティブが参照する事業法人等。ただし、当該信用デリバティブがインデックス・クレジット・デフォルト・スワップの場合には、当該インデックス。

$\rho_k^{(Credit)}$は、Entity$_k$に係る相関係数

二　前号の算式中AddOn（Entity$_k$）は、次のイ又はロに掲げる信用デリバティブの区分に応じ、当該イ又はロに定める掛目をそれぞれ信用デリバティブに係る実効想定元本額に乗じて得た額の合計額とする。

イ　事業法人等を参照する信用デリバティブ　次の表の上欄に掲げる適格格付機関により付与された事業法人等の格付に対応する信用リスク区分に応じ、同表の下欄に定める掛目

適格格付機関により付与された事業法人等の格付に対応する信用リスク区分	掛目（パーセント）
1―1	○・三八
1―2	○・四二
1―3	○・五四
1―4	一・○六
1―5	一・六○
1―6	六・○○

（注）　第二十七条第一項に掲げる主体以外の主体の信用リスク区分についても、同項第一号の表を準用するものとする。

ロ　インデックスを参照する信用デリバティブ　次の表の上欄に掲げる適格格付機関により付与された格付に対応する信用リスク区分に応じ、同表の下欄に定める掛目

適格格付機関により付与された格付に対応する信用リスク区分	掛目（パーセント）
4―3又は5―3以上	○・三八
4―3又は5―3未満	一・○六

三　第一号の算式中$\rho_k^{(Credit)}$は、次のイ又はロに掲げる信用デリバティブの区分に応じ、当該イ又はロに定める値とする。

イ　事業法人等を参照する信用デリバティブ　○・五

ロ　インデックスを参照する信用デリバティブ　○・八

四　第二号の信用デリバティブに係る実効想定元本額は、当該信用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の算出については、第十一項第五号の規定を準用する。この場合において、「前号」とあるのは「第十三項第四号」と、「金利デリバティブに」とあるのは「信用デリバティブに」と、「金利デリバティブi」とあるのは「金利契約」とあるのは「原債務者に係る契約」と、「金利デリバティブの」とあるのは「信用デリバティブの」と、「金利デリバティブ又は負債性商品」とあるのは「信用デリバティブ」と、「金利デリバティブが」とあるのは「信用デリバティブが」と、「金利等又は負債性商品の金利等」とあるのは「原債務者に係る契約」と読み替えるものとする。