五　前号のデルタ調整値は、次のイからハまでに掲げる取引の区分に応じ、当該イからハまでに定める値とする。

イ　オプション　値の算出については、第十一項第六号（イに係る部分に限る。）の規定を準用する。この場合において、「第四号のデルタ調整値」とあるのは「第十四項第四号のデルタ調整値（同項第五号イに掲げる取引の区分に係るものに限る。）」と、「イからハまで」とあるのは「イ」と、「金利等」とあるのは「株価又は株価指数等」と、「αは、〇・五」とあるのは「αは、当該エクイティ・デリバティブが株価を参照する場合にあっては一・二〇、株価指数を参照する場合にあっては〇・七五」と読み替えるものとする。

ロ　イに掲げる取引以外の取引のうち、当該エクイティ・デリバティブが参照する株価又は株価指数等が上昇する場合に、当該エクイティ・デリバティブの時価が上昇するもの　一

ハ　イに掲げる取引以外の取引のうち、当該エクイティ・デリバティブが参照する株価又は株価指数等が上昇する場合に、当該エクイティ・デリバティブの時価が下落するもの　マイナス一

六　第十一項第七号から第九号までの規定は、第四号のマージン期間調整値の算出について準用する。この場合において、同項第七号中「第四号」とあるのは「第十四項第四号」と、「金利デリバティブ」とあるのは「エクイティ・デリバティブ」と、同項第八号中「第十一項第七号ロ」とあるのは「第十四項第六号において読み替えて準用する第十一項第七号ロ」と、同項第九号中「第十一項第八号において読み替えて準用する前項の」とあるのは「第十四項第六号において読み替えて準用する第十一項第八号において読み替えて準用する前項の」と、「第十一項第八号において読み替えて準用する前項各号」とあるのは「第十四項第六号において読み替えて準用する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。

15　第六項の算式中$AddOn^{(Com)}$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。

$$AddOn^{(Com)}=\sum_{j}AddOn_{[HS]}^{(Com)}$$

$$AddOn_{[HS]}^{(Com)}=\left[(\rho_{j}^{(Com)}\times\sum_{k}AddOn\ (Type_{k}))^{2}+(1-(\rho_{j}^{(Com)})^{2})\times\sum_{k}(AddOn\ (Type_{k}))^{2}\right]^{\frac{1}{2}}$$

$AddOn_{[HS]}^{(Com)}$は、ヘッジセットjに係るアドオンの額

$AddOn\ (Type_{k})$は、ヘッジセットjにおいてコモディティkを参照するコモディティ・デリバティブに係るアドオンの額の合計額

$\rho_{j}^{(Com)}$は、0.4

二　前号の算式中$AddOn\ (Type_{k})$は、次の表の上欄に掲げるコモディティ・デリバティブの区分に応じ、同表の下欄に定める掛目を、当該コモディティ・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。

コモディティ・デリバティブの区分	掛目（パーセント）
第八項各号に定めるヘッジセットに含まれるコモディティ・デリバティブのうち、電力を参照するコモディティ・デリバティブ	四十