ロ　イに掲げる取引以外の取引のうち、当該外国為替デリバティブが参照する為替レート等が上昇する場合に、当該外国為替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、当該外国為替デリバティブが参照する為替レート等が上昇する場合に、当該外国為替デリバティブの時価が下落するもの　マイナス一

五　前項第七号から第九号までの規定は、第三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「次項第三号」と、「金利デリバティブ」とあるのは「外国為替デリバティブ」と、同項第八号中「第十一項第七号ロ」とあるのは「第十二項第五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「第十二項第五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「第十二項第五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。

13　第六項の算式中$AddOn^{(Credit)}$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。

$$AddOn^{(Credit)} = \left[\left(\sum_k \rho_k^{(Credit)} \times AddOn\ (Entity_k)\right)^2 + \sum_k \left(1 - \left(\rho_k^{(Credit)}\right)^2\right) \times \left(AddOn\ (Entity_k)\right)^2\right]^{\frac{1}{2}}$$

$AddOn\ (Entity_k)$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	〇・三八
1―2	〇・四二
1―3	〇・五四
1―4	一・〇六
1―5	一・六〇
1―6	六・〇〇

（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。