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。以下この項及び第五十六条の四の三において同じ。）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$AddOn_j^{(IR)}$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。

$$AddOn_j^{(IR)} = \sum_k AddOn_j^{(IR)}$$

$AddOn_j^{(IR)}$は、通貨j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

三　前号に規定するヘッジセットに係る実効想定元本額を算出する場合には、次のイ又はロのいずれかの算式を用いて算出する。

イ　$\sqrt{(D_1^{(IR)})^2+(D_2^{(IR)})^2+(D_3^{(IR)})^2+1.4\times D_1^{(IR)}\times D_2^{(IR)}+1.4\times D_2^{(IR)}\times D_3^{(IR)}+0.6\times D_1^{(IR)}\times D_3^{(IR)}}$

$D_1^{(IR)}$は、通貨j建てであり、かつ、E_i（第五号に規定するE_iをいう。以下この号において同じ。）が一年未満である金利デリバティブに係る実効想定元本額の合計額（口において同じ。）

$D_2^{(IR)}$は、通貨j建てであり、かつ、E_iが一年以上五年以下である金利デリバティブに係る実効想定元本額の合計額（口において同じ。）

$$\left[(D_1^{(IR)})^2+(D_2^{(IR)})^2+(D_3^{(IR)})^2+1.4\times D_1^{(IR)}\times D_2^{(IR)}+1.4\times D_2^{(IR)}\times D_3^{(IR)}+0.6\times D_1^{(IR)}\times D_3^{(IR)}\right]^{\frac{1}{2}}$$