その他（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が4―4であるもの）	八・〇〇
同（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が4―5又は5―4であるもの）	十二・〇〇
同（無格付であるもの）	八・〇〇

（注1）「政府債」とは、中央政府又は我が国の地方公共団体の発行する債券及びそれらの保証する債券をいう。

（注2）「優良債」とは、公共部門又は国際開発銀行の発行した債券等、金融機関（第一条第七号ロ及びヘに掲げる者を除く。）、銀行持株会社、銀行持株会社に準ずる外国の会社、第一種金融商品取引業者及び経営管理会社の発行した債券等のうち第三十条又は第三十一条の規定により二十パーセントのリスク・ウェイトとすることが認められているもの、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が4―3又は5―3以上である債券等並びに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が6―3、7―3又は8―8以上である格付を付している証券化エクスポージャーをいう。

2　前章第一節及び第二節第一款並びに前項の規定は、証券化エクスポージャー（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が6―3、7―3又は8―8以上である格付を付している証券化エクスポージャーを除く。）の個別リスクについて準用する。この場合において、同章第一節及び第二節第一款に定めるリスク・ウェイトを十二・五で除して得た値を前項の表のリスク・ウェイトとする。

（金利リスク・カテゴリーの一般市場リスク）

第二百六十三条　第二百五十八条第一号に掲げる金利リスク・カテゴリーの一般市場リスクの額は、次条に定めるマチュリティ法又は第二百六十五条に定めるデュレーション法を用いて通貨ごとに算出した次の第一号から第三号までに掲げるものの合計額とする。ただし、デュレーション法を用いる最終指定親会社は、価格感応度の計測方法に関する事項を記載した書類を作成し、保存するとともに、当該計測方法を継続して使用しなければならない。

一　債券等の全体のネット・ポジションの額

二　マチュリティ法を用いる場合は次のイの表に、デュレーション法を用いる場合は次のロの表に掲げる各期間帯内で対当しているポジション間のバーティカル・ディスアローアンス（同一期間帯内において対当するポジション同士を相殺する場合において、対当している部分に一定の割合を乗じて得られるものであって、マーケット・リスク相当額に追加する部分をいう。以下同じ。）の額

イ　マチュリティ法の期間帯等

期間帯（残存期間等）		リスク・ウェイト（パーセント）	想定金利変動幅（パーセント・ポイント）
表面利率三パーセント以上	一月以下	零	一・〇〇
	一月超　三月以下	〇・二〇	一・〇〇
	三月超　六月以下	〇・四〇	一・〇〇
	六月超　十二月以下	〇・七〇	一・〇〇
	一年超　二年以下	一・二五	〇・九〇
表面利率三パーセント未満	一月以下	〇・二〇	一・〇〇
	一月超　三月以下	〇・四〇	一・〇〇
	三月超　六月以下	〇・七〇	一・〇〇
	六月超　十二月以下	一・二五	一・〇〇
	一年超　二年以下	一・七五	〇・八〇
	二年超　三年以下	二・二五	〇・七五
	三年超　四年以下	二・七五	〇・七五
	四年超　五年以下	三・二五	〇・七〇
	五年超　七年以下	三・七五	〇・六五
	七年超　十年以下	四・五〇	〇・六〇
	十年超　十五年以下	五・二五	〇・六〇
	十五年超　二十年以下	六・〇〇	〇・六〇
	二十年超	八・〇〇	〇・六〇

（注）　ゼロ・クーポン債は表面利率三パーセント未満の債券として扱うこととする。

ロ　デュレーション法の期間帯等

期間帯（残存期間等）	想定金利変動幅（パーセント・ポイント）
一月以下	一・〇〇
一月超　三月以下	一・〇〇
三月超　六月以下	一・〇〇
六月超　十二月以下	一・〇〇
一年超　二年以下	〇・九〇
二年超　三年以下	〇・八〇
三年超　四年以下	〇・七五
四年超　五年以下	〇・七〇
五年超　七年以下	〇・六五
七年超　十年以下	〇・六〇
十年超　十五年以下	〇・六〇
十五年超　二十年以下	〇・六〇
二十年超	〇・六〇