出した特定順位参照型クレジット・デリバティブに係る個別リスクの額及び自己資本比率告示第三百二条の九又は持株自己資本比率告示第二百八十条の九に規定する修正標準方式を用いて算出したコリレーション・トレーディングに係る個別リスクの額の合計額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

i　項番９「合計」の項には、項番１から項番８までの合計額を記載すること。

j　項番９「合計」の額は、第一面の項番17「マーケット・リスク　うち、標準的方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

k　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「－」を記載すること。

l　この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。

（第二十二面）

（単位：百万円）

ＭＲ３：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

項番		
	バリュー・アット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99％）	
1	最大値	
2	平均値	
3	最小値	
4	期末	
	ストレス・バリュー・アット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99％）	
5	最大値	
6	平均値	
7	最小値	
8	期末	
	追加的リスクの額（片側信頼区間99.9％）	
9	最大値	
10	平均値	
11	最小値	
12	期末	
	包括的リスクの額（片側信頼区間99.9％）	
13	最大値	
14	平均値	
15	最小値	
16	期末	
17	フロア（修正標準的方式）	

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、自己資本比率告示及び持株自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a　「バリュー・アット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99％）」の項番１から項番４までの項には、自己資本比率告示第二百七十六条第一項第一号イ又は持株自己資本比率告示第二百五十四条第一項第一号イに規定する期中における一般市場リスク及び個別リスクのバリュー・アット・リスクの額に係る計数を記載すること。

b　「ストレス・バリュー・アット・リスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99％）」の項番５から項番８までの項には、自己資本比率告示第二百七十六条第一項第二号イ又は持株自己資本比率告示第二百五十四条第一項第二号イに規定する期中における一般市場リスク及び個別リスクのストレス・バリュー・アット・リスクの額に係る計数を記載すること。

c　「追加的リスクの額（片側信頼区間99.9％）」の項番９から項番12までの項には、自己資本比率告示第二百七十六条第二項第一号又は持株自己資本比率告示第二百五十四条第二項第一号に規定する期中における追加的リスクの額に係る計数を記載すること。

d　「包括的リスクの額（片側信頼区間99.9％）」の項番13から項番17までの項には、自己資本比率告示第三百二条の十一第一号又は持株自己資本比率告示第二百八十条の十一第一号に規定する期中におけるコリレーション・トレーディングの包括的リスクの額に係る計数を記載すること。ただし、項番17の「フロア（修正標準的方式）」の項には、自己資本比率告示第三百二条の十一第三号又は持株自己資本比率告示第二百八十条の十一第三号に掲げる額を記載すること。

e　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「－」を記載すること。

f　この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。

g　この面は、自金融機関が標準的方式を採用した場合にあっては、作成することを要しない。

（第二十三面）

ＭＲ４：内部モデル方式のバック・テスティングの結果

