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二百五十九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二百五十九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二百五十九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二百八十五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二百八十五条の十一第三号に掲げる額を記載すること。

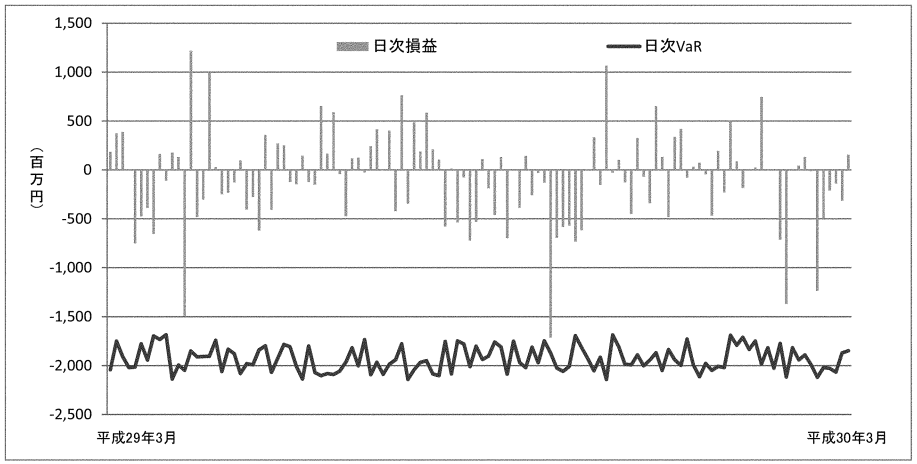
e　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「―」を記載すること。

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。

（第二十九面）

ＭＲ４：内部モデル方式のバック・テスティングの結果



(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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a　この面においては、自己資本比率告示第二百五十七条第二項第二号に定めるバック・テスティングの結果を図示すること（上記は凡例である。）。

b　系列「日次ＶａＲ」は、自己資本比率告示第二百六十条第一項に規定する保有期間を一日としてリスク計測モデル（追加的リスク計測モデル及び自己資本比率告示第二百八十五条の十第三項第三号に規定する包括的リスク計測モデルを除く。）を使用して算出した日ごとのバリュー・アット・リスクの額をいう。

c　系列「日次損益」は、自己資本比率告示第二百六十条第一項に規定する実際に発生した損益（以下「実損益」という。）又はポートフォリオを固定した場合において発生したと想定される損益（以下「仮想損益」という。）のうち、自金融機関が採用している損益の額をいう。ただし、実損益及び仮想損益のいずれも開示することもできるものとし、その場合には二の損益の主要な差異項目について定性的な説明を併せて記載すること。

d　報告基準日を含む直近250営業日分のバック・テスティングの結果を記載すること。バック・テスティングの超過については、超過日、超過額及び超過の主要な要因について記載すること。

e　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。

（第三十面）

（単位：百万円）

ＩＲＲＢＢ１：金利リスク

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		ΔＥＶＥ		ΔＮＩＩ	
		当期末	前期末	当期末	前期末
1	上方パラレルシフト				
2	下方パラレルシフト				
3	スティープ化				
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値				
		ホ		ヘ	
		当期末		前期末	
8	Tier１資本の額				

(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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

また、自金融機関がこの面の定めるところにより記載が必要とされている金利リスク以外の金利リスクを計測している場合には、当該金利リスクを追加して記載することができる。

a　この面において「ΔＥＶＥ」とは、金利リスクのうち、金利ショックに対する経済的価値の減少額として計測されるものをいう。