トルコ通貨	500	300
アメリカ合衆国通貨	300	150
南アフリカ共和国通貨	500	300
その他の通貨	100から500のうち、自金融機関が定める値	100から300のうち、自金融機関が定める値

f　この面において「フラット化」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、次の算式を用いて得た金利変動幅（以下この面において「フラット化に関する金利変動幅」という。）を加える金利ショックをいう。

$$\Delta R_{flattener,c}(t) = 0.8 \cdot \left(\bar{R}_{short,c} \cdot e^{\frac{-t}{\tau}}\right) - 0.6 \cdot \left\{\bar{R}_{long,c} \cdot \left(1 - e^{\frac{-t}{\tau}}\right)\right\}$$

$\Delta R_{flattener,c}(t)$は、フラット化に関する金利変動幅

g　この面において「短期金利上昇」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、次の算式を用いて得た金利変動幅（以下この面において「短期金利上昇に関する金利変動幅」という。）を加える金利ショックをいう。

$$\Delta R_{short,c}(t) = \bar{R}_{short,c} \cdot e^{\frac{-t}{\tau}}$$

$\Delta R_{short,c}(t)$は、短期金利上昇に関する金利変動幅

h　この面において「短期金利低下」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、短期金利上昇に関する金利変動幅にマイナス１を乗じて得た数値を加える金利ショックをいう。

i　項番１「上方パラレルシフト」の項には、上方パラレルシフトに基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）及びΔＮＩＩ（ハ欄及びニ欄）を記載すること。

j　項番２「下方パラレルシフト」の項には、下方パラレルシフトに基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）及びΔＮＩＩ（ハ欄及びニ欄）を記載すること。

k　項番３「スティープ化」の項には、スティープ化に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

l　項番４「フラット化」の項には、フラット化に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

m　項番５「短期金利上昇」の項には、短期金利上昇に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

n　項番６「短期金利低下」の項には、短期金利低下に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

o　項番７「最大値」の項イ欄及びロ欄には、それぞれの欄の項番１から項番６までの値のうち最大のものを記載すること。

p　項番７「最大値」の項ハ欄及びニ欄には、それぞれの欄の項番１又は項番２の値のうちいずれか大きいものを記載すること。

q　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。

r　この面におけるロ欄、ニ欄及びヘ欄の「前期末」が平成三十年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

［(別紙様式第三号)　別紙２］

（第一面）

（単位：百万円）

ＯＶ１：リスク・アセットの概要

国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当中間期末	前中間期末	当中間期末	前中間期末
1	信用リスク				
2	うち、標準的手法適用分				
3	うち、内部格付手法適用分				
	うち、重要な出資のエクスポージャー				
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー				
	その他				
4	カウンターパーティ信用リスク				
5－1	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分				
5－2	うち、標準方式適用分				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分				
	うち、ＣＶＡリスク				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー				
	その他				
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー				
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー				
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー				
11	未決済取引				