（第二十一面）
（単位：百万円）

ＭＲ１：標準的方式によるマーケット・リスク相当額		
項番		リスク・アセット （リスク相当額を８％で除して得た額）
1	金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	
2	株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額	
3	外国為替リスクの額	
4	コモディティ・リスクの額	
	オプション取引	
5	簡便法により算出した額	
6	デルタ・プラス法により算出した額	
7	シナリオ法により算出した額	
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	
9	合計	

(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　項番１「金利リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額」の項には、自己資本比率告示第二百六十四条の規定により算出した金利リスク・カテゴリーのマーケット・リスク相当額（同条に規定する債券等に係る個別リスクの額及び一般市場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。

b　項番２「株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額」の項には、自己資本比率告示第二百七十一条の規定により算出した株式リスク・カテゴリーのマーケット・リスク相当額（同条に規定する株式等に係る個別リスクの額及び一般市場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。

c　項番３「外国為替リスクの額」の項には、自己資本比率告示第二百七十四条の規定により算出した外国為替リスク・カテゴリーのマーケット・リスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

d　項番４「コモディティ・リスクの額」の項には、自己資本比率告示第二百七十六条の規定により算出したコモディティ・リスク・カテゴリーのマーケット・リスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

e　項番５「オプション取引　簡便法により算出した額」の項には、自己資本比率告示第二百七十八条の規定により算出した簡便法を用いる場合のオプション取引等に係るマーケット・リスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

f　項番６「オプション取引　デルタ・プラス法により算出した額」の項には、自己資本比率告示第二百七十九条の規定により算出したオプション取引等に係るマーケット・リスク相当額（同条第二号に規定するガンマ・リスク及び同条第三号に規定するベガ・リスクに係るマーケット・リスク相当額の合計額）を８パーセントで除して得た額を記載すること。

g　項番７「オプション取引　シナリオ法により算出した額」の項には、自己資本比率告示第二百八十五条の規定により算出したシナリオ法を用いる場合のオプション取引等に係るマーケット・リスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

h　項番８「証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額」の項には、自己資本比率告示第二百八十五条の二から第二百八十五条の五までの規定により算出した証券化エクスポージャーの個別リスクの額、自己資本比率告示第二百八十五条の六の規定により算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二百八十五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	