（第二十八面）
（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二百五十三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二百五十三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二百五十三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二百七十九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二百七十九条の十一第三号に掲げる額を記載すること。

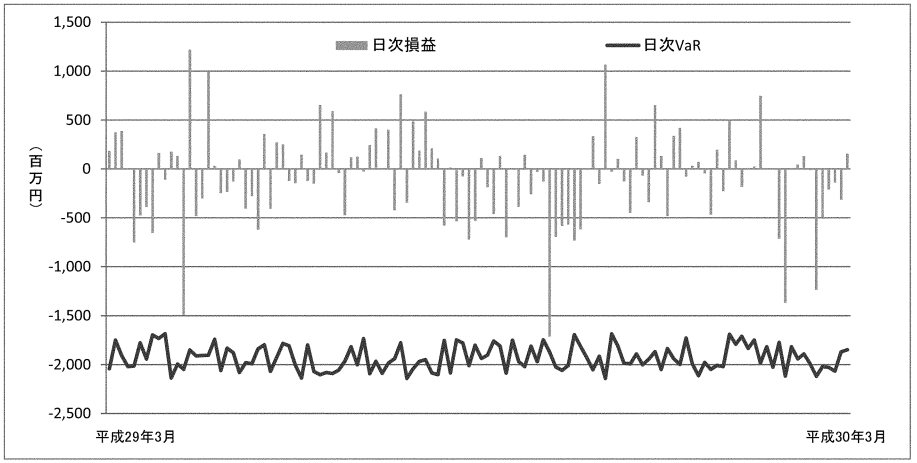
e　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「―」を記載すること。

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二百五十一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二百五十四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二百七十九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。