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二百七十二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二百七十三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二百七十九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二百七十九条の二から第二百七十九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二百七十九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二百七十九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。