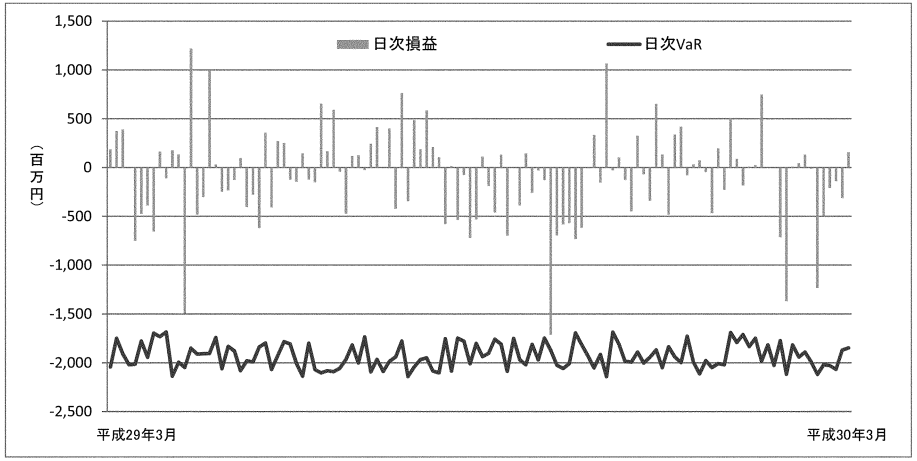
ＭＲ４：内部モデル方式のバック・テスティングの結果




(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。

ｃ　系列「日次損益」は、自己資本比率告示第二百五十四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。

（第二十四面）

（単位：百万円）

ＩＲＲＢＢ１：金利リスク

| 項番 | | イ | ロ | ハ | ニ |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ΔＥＶＥ | | ΔＮＩＩ | |
| | | 当半期末 | 前半期末 | 当半期末 | 前半期末 |
| 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 | |
| | | 当半期末 | | 前半期末 | |
| 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。

ｂ　この面において「ΔＮＩＩ」とは、金利リスクのうち、金利ショックに対する算出基準日から12ヶ月を経過する日までの間の金利収益の減少額として計測されるものをいう。

ｃ　この面において「上方パラレルシフト」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、次の表に定める「パラレルシフトに関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）」を加える金利ショックをいう。

| 通貨 | パラレルシフトに関する金利変動幅（ベーシス・ポイント） |
|---|---|
| アルゼンチン通貨 | 400 |
| オーストラリア通貨 | 300 |
| ブラジル通貨 | 400 |
| カナダ通貨 | 200 |
| スイス通貨 | 100 |
| 中華人民共和国通貨 | 250 |
| 欧州経済通貨統合参加国通貨 | 200 |
| 英国通貨 | 250 |
| 中華人民共和国（香港特別行政区）通貨 | 200 |