

(単位：百万円)

IRRBB 1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		当期末	前期末	当期末	前期末
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	
		当期末		前期末	
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「△EVE」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「△NII」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（ベースス・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(ベースス・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
インドネシア通貨	400
インド通貨	400
本邦通貨	100
大韓民国通貨	300
メキシコ通貨	400
ロシア通貨	400
サウジアラビア通貨	200
スウェーデン通貨	200
シンガポール通貨	150
トルコ通貨	400
アメリカ合衆国通貨	200
南アフリカ共和国通貨	400
その他の通貨	100 から 400 のうち、自金融機関が定める値

d この面において「下方パラレルシフト」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、cの表に定める「パラレルシフトに関する金利変動幅（ベース・ポイント）」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。

e この面において「スティープ化」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「スティープ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。

$$\Delta R_{steepener,c}(t) = -0.65 \cdot \left(\bar{R}_{short,c} \cdot e^{-\frac{t}{x}} \right) + 0.9 \cdot \left\{ \bar{R}_{long,c} \cdot \left(1 - e^{-\frac{t}{x}} \right) \right\}$$

$\Delta R_{steepener,c}(t)$ は、スティープ化に関する金利変動幅

cは、通貨（以下この面において同じ。）

tは、将来の期間を年数で表した値（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{short,c}$ は、通貨に応じて、次の表に定める「短期金利に関する金利変動幅（ベース・ポイント）」（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{long,c}$ は、通貨に応じて、次の表に定める「長期金利に関する金利変動幅（ベース・ポイント）」（以下この面において同じ。）

xは、4（以下この面において同じ。）

通貨	短期金利に関する金利変動幅 (ベース・ポイント)	長期金利に関する金利変動幅 (ベース・ポイント)
アルゼンチン通貨	500	300
オーストラリア通貨	450	200

ブラジル通貨	500	300
カナダ通貨	300	150
スイス通貨	150	100
中華人民共和国通貨	300	150
欧州経済通貨統合参加国通貨	250	100
英国通貨	300	150
中華人民共和国（香港特別行政区）通貨	250	100
インドネシア通貨	500	300
インド通貨	500	300
本邦通貨	100	100
大韓民国通貨	400	200
メキシコ通貨	500	300
ロシア通貨	500	300
サウジアラビア通貨	300	150
スウェーデン通貨	300	150
シンガポール通貨	200	100
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。

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

$\Delta R_{flattener,c}(t)$ 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。

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

$\Delta R_{short,c}(t)$ 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△EVE（イ欄及びロ欄）及び△NII（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△EVE（イ欄及びロ欄）及び△NII（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△EVE（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△EVE（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△EVE（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△EVE（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。

(単位：百万円)

IRRBB 1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		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「△EVE」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「△NII」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
インドネシア通貨	400
インド通貨	400
本邦通貨	100
大韓民国通貨	300
メキシコ通貨	400
ロシア通貨	400
サウジアラビア通貨	200
スウェーデン通貨	200
シンガポール通貨	150
トルコ通貨	400
アメリカ合衆国通貨	200
南アフリカ共和国通貨	400
その他の通貨	100 から 400 のうち、自金融機関が定める値

d この面において「下方パラレルシフト」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、cの表に定める「パラレルシフトに関する金利変動幅（ベース・ポイント）」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。

e この面において「スティープ化」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「スティープ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。

$$\Delta R_{steepener,c}(t) = -0.65 \cdot \left(\bar{R}_{short,c} \cdot e^{-\frac{t}{x}} \right) + 0.9 \cdot \left\{ \bar{R}_{long,c} \cdot \left(1 - e^{-\frac{t}{x}} \right) \right\}$$

$\Delta R_{steepener,c}(t)$ は、スティープ化に関する金利変動幅

cは、通貨（以下この面において同じ。）

tは、将来の期間を年数で表した値（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{short,c}$ は、通貨に応じて、次の表に定める「短期金利に関する金利変動幅（ベース・ポイント）」（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{long,c}$ は、通貨に応じて、次の表に定める「長期金利に関する金利変動幅（ベース・ポイント）」（以下この面において同じ。）

xは、4（以下この面において同じ。）

通貨	短期金利に関する金利変動幅 (ベース・ポイント)	長期金利に関する金利変動幅 (ベース・ポイント)
アルゼンチン通貨	500	300
オーストラリア通貨	450	200

ブラジル通貨	500	300
カナダ通貨	300	150
スイス通貨	150	100
中華人民共和国通貨	300	150
欧州経済通貨統合参加国通貨	250	100
英国通貨	300	150
中華人民共和国（香港特別行政区）通貨	250	100
インドネシア通貨	500	300
インド通貨	500	300
本邦通貨	100	100
大韓民国通貨	400	200
メキシコ通貨	500	300
ロシア通貨	500	300
サウジアラビア通貨	300	150
スウェーデン通貨	300	150
シンガポール通貨	200	100
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。

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

$\Delta R_{flattener,c}(t)$ 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。

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

$\Delta R_{short,c}(t)$ 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△EVE（イ欄及びロ欄）及び△NII（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△EVE（イ欄及びロ欄）及び△NII（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△EVE（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△EVE（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△EVE（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△EVE（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「前半期末」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。