

オフ・サイト・モニタリングにおける主要指標

リスクデータの表題		提出頻度	主要指標
市場 リスク	トレーディング勘定市場関連リスク	週	デルタ・ポジション、VaR
	バンキング勘定市場関連リスク	月	デルタ・ポジション、VaR
	投資有価証券内訳	月	時価評価ポジション、等価ポジション
	バンキング勘定市場リスク	月	金利リプライスのギャップ、期前解約率
	市場取引信用リスク		
	(1)個別リスク	四半期	金利関連個別リスク、株式関連個別リスク
(2)信用リスク相当額	半期	クレジットエクスポージャー(グロス、ネット)	
流動性 リスク	銀行業務調達・運用	月	コア預金のポジション比率、ホットマネー比率
	市場取引調達・運用		
	(1)円貨による市場取引調達・運用	月	円資金調達期間構成
	(2)外貨による市場取引調達	週	ドル資金調達期間構成
	期間別決済金額	月	決済金額ピーク、決済予定金額
	大口調達先20社	月	
	流動性準備	月	
信用 リスク	業種別信用リスク指標一覧表		
	(1)業種・格付別基本情報	四半期	与信相当額、与信関連粗利益率
	(2)全業種格付トータル	四半期	クレジットデリバティブ額、流動化額、信用VaR
	貸付上位20社一覧表	四半期	
	個人与信情報[貸付種別]	四半期	与信相当額、与信関連粗利益率、信用VaR
	海外与信情報	四半期	与信相当額、与信関連粗利益率、クレジットデリバティブ額、流動化額、信用VaR