

正誤表

60 ページ「8 金利リスクに関する事項」に下記のとおり誤りがありましたので、お詫び申し上げ訂正いたします。

正	誤
<p>①金利リスクの算定方法の概要</p> <p>(略)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・上方金利ショック幅は99パーセンタイル値、下方金利ショック幅は1パーセンタイル値で算出しています。 <p><u>(削除)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> ・要求払貯金の金利リスク量は、明確な金利改定間隔がなく、貯金者の要求によって随時払い出される要求払貯金のうち、引き出されることなく長期間金融機関に滞留する貯金をコア貯金と定義し、①過去5年の最低残高、②過去5年の最大年間流出量を現残高から差し引いた残高、③現残高の50%相当額のうち、最小の額を上限とし、0～5年の期間に均等に振り分けて（平均残存2.5年）リスク量を算定しています。 ・金利リスクは、運用勘定の金利リスク量と調達勘定の金利リスク量を相殺して算定します。 <p>金利リスク＝運用勘定の金利リスク量＋調達勘定の金利リスク量（△）</p> <p>(略)</p>	<p>①金利リスクの算定方法の概要</p> <p>(略)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・上方金利ショック幅は99パーセンタイル値、下方金利ショック幅は1パーセンタイル値で算出しています。 <p><u>ただし、下方金利ショックの計算にあたっては、0%を下限（ディスカウントファクターは1を上限）としています。</u></p> <ul style="list-style-type: none"> ・要求払貯金の金利リスク量は、明確な金利改定間隔がなく、貯金者の要求によって随時払い出される要求払貯金のうち、引き出されることなく長期間金融機関に滞留する貯金をコア貯金と定義し、①過去5年の最低残高、②過去5年の最大年間流出量を現残高から差し引いた残高、③現残高の50%相当額のうち、最小の額を上限とし、0～5年の期間に均等に振り分けて（平均残存2.5年）リスク量を算定しています。 ・金利リスクは、運用勘定の金利リスク量と調達勘定の金利リスク量を相殺して算定します。 <p>金利リスク＝運用勘定の金利リスク量＋調達勘定の金利リスク量（△）</p> <p>(略)</p>