

VIII. 銀行勘定における金利リスク

銀行勘定における金利リスクに関して内部管理上使用した金利ショックに対する経済価値の増減額

【連結】

連結子会社の金利リスク量は僅少であるため、連結での金利ショックに対する経済価値の増減額の算出は行っておりません。

【単体】

(単位：百万円)

	平成19年9月30日
金利リスク	43,037
うち国内債券	27,052
うち外国債券	1,065
うち円貨預貸金等	14,920

- (注) 1. 使用した金利ショック VaR (バリュアットリスク)
 国内債券・外国債券 保有期間40日、観測期間250日、信頼区間99.9%
 円貨預貸金等 保有期間40日、観測期間12か月、信頼区間99.9%
2. VaRとは、過去のデータを統計的に分析し、将来の一定期間（保有期間）において一定確率（信頼区間）で起こりうる最大の損失額を計測するリスク管理手法です。VaRの算出結果は、保有期間、信頼区間、データの計測手法によって異なります。