(6) 保有する証券化エクスポージャーの適切な数のリスク・ウェイトの区分ごとの残高及び所要自己資本の額（再証券化エクスポージャーについて区別して記載することを要する。）

(7) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳

(8) 証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額及び主な原資産の種類別の内訳

(9) 自己資本比率告示第二百七十九条の五第二項の規定により自己資本から控除した証券化エクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

(10) 早期償還条項付の証券化エクスポージャーについて、次に掲げる事項（主な原資産の種類別の内訳を含む。）

(i) 早期償還条項付の証券化エクスポージャーを対象とする実行済みの信用供与の額

(ii) 連結グループがオリジネーターとして留保する早期償還条項付の証券化エクスポージャーを対象とする実行済みの信用供与の額及び想定元本額の未実行の部分の信用供与額のＥＡＤの額の合計額に対する所要自己資本の額

(iii) 連結グループが投資家の持分に対して算出する早期償還条項付の証券化エクスポージャーを対象とする実行済みの信用供与の額及び想定元本額の未実行の部分の信用供与額のＥＡＤの額の合計額に対する所要自己資本の額

ニ 連結グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項

(1) 保有する証券化エクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳（再証券化エクスポージャーについて区別して記載することを要する。）

(2) 保有する証券化エクスポージャーの適切な数のリスク・ウェイトの区分ごとの残高及び所要自己資本の額（再証券化エクスポージャーについて区別して記載することを要する。）

(3) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳

(4) 自己資本比率告示第二百七十九条の五第二項の規定により自己資本から控除した証券化エクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

第三条第三項第八号中ロをニとし、イの次に次のように加える。

ロ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値

ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額

○財務省告示第百七十五号

国債証券買入銷却法（明治二十九年法律第五号）第二条の規定に基づき、同法第一条第一項の規定により平成二十三年四月二十二日に買入消却した国債の名称等を別表のとおり告示する。

平成二十三年五月二十七日

財務大臣　野田　佳彦

（別表）

国債の名称	記号	額面金額の総額	額面金額百円当たりの買入価格
利付国庫債券（変動・十五年）	第八回	一億円	百円五十四銭
〃	〃	五億円	百円七十四銭
〃	第九回	七億円	百円四十銭
〃	第十回	十二億円	九十九円九十五銭
〃	〃	五億円	百円二十銭
〃	第十二回	四十一億円	九十九円九十銭
〃	第十三回	十億円	九十九円五十三銭
〃	第十四回	十六億円	九十九円五十四銭
〃	〃	十億円	九十九円六十九銭
〃	〃	十億円	九十九円七十五銭
〃	〃	十五億円	九十九円七十九銭
〃	第十五回	十億円	九十九円三十四銭
〃	〃	四億円	九十九円四十四銭
〃	第十六回	七億円	九十九円十九銭
〃	〃	十億円	九十九円二十五銭
〃	〃	十億円	九十九円三十銭
〃	〃	十億円	九十九円三十五銭
〃	〃	五億円	九十九円三十九銭
〃	〃	十億円	九十九円四十銭
〃	〃	二十億円	九十九円四十五銭
〃	〃	七十九億円	九十九円四十八銭
〃	第十九回	五億円	九十九円五十五銭
〃	〃	五億円	九十九円六十一銭
〃	〃	五億円	九十九円六十五銭
〃	第二十一回	二百五十億円	百円六十五銭
〃	〃	十億円	百円六十九銭
〃	〃	十億円	百円七十四銭
〃	〃	一億円	百円八十四銭
〃	第二十二回	四十五億円	百一円五十四銭
〃	〃	五十五億円	百一円五十九銭