ヘ　銀行が証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合には、当該証券化目的導管体の種類及び当該銀行が当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別
ト　銀行の子法人等（連結子法人等を除く。）及び関連法人等のうち、当該銀行が行った証券化取引（銀行が証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む。）に係る証券化エクスポージャーを保有しているものの名称
チ　証券化取引に関する会計方針
リ　証券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称（使用する適格格付機関を変更した場合には、その理由を含む。）
ヌ　内部評価方式を用いている場合には、その概要
ル　定量的な情報に重要な変更が生じた場合には、その内容
六　マーケット・リスクに関する次に掲げる事項（自己資本比率告示第十四条各号の算式にマーケット・リスク相当額に係る額を算入する場合に限る。）
イ　リスク管理の方針及び手続の概要
ロ　マーケット・リスク相当額の算出に使用する方式の名称（複数の方式を使用する場合には、業務の別、拠点の別又は個別リスク若しくは一般市場リスクの別に開示することを要する。）
ハ　想定される保有期間及び保有期間が想定を超える蓋然性等を踏まえ、取引の特性に応じて適切に価格を評価するための方法
ニ　内部モデル方式を使用する場合における使用するモデルの概要並びにバック・テスティング及びストレス・テストの説明
ホ　追加的リスクを内部モデルで計測している場合には、当該内部モデルの概要
ヘ　包括的リスクを内部モデルで計測している場合には、当該内部モデルの概要
ト　マーケット・リスクに対する自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法
七　オペレーショナル・リスクに関する次に掲げる事項
イ　リスク管理の方針及び手続の概要
ロ　オペレーショナル・リスク相当額の算出に使用する手法の名称（部分的に先進的計測手法を使用する場合は、各手法の適用範囲を含む。）
ハ　先進的計測手法を使用する場合における次に掲げる事項
(1)　当該手法の概要
(2)　保険によるリスク削減の有無（保険によるリスク削減を行った場合は、保険の利用方針と概要を含む。）
八　銀行勘定における銀行法施行令（昭和五十七年政令第四十号）第四条第四項第三号に規定する出資その他これに類するエクスポージャー（以下「出資等」という。）又は株式等エクスポージャーに関するリスク管理の方針及び手続の概要
九　銀行勘定における金利リスクに関する次に掲げる事項
イ　リスク管理の方針及び手続の概要
ロ　銀行が内部管理上使用した銀行勘定における金利リスクの算定手法の概要
十　貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示事項である別紙様式第一号に記載する項目のいずれに相当するかについての説明

4　第一項の定量的な開示事項は、次に掲げる事項とする。
一　自己資本の充実度に関する次に掲げる事項
イ　信用リスクに対する所要自己資本の額（ロ及びハの額を除く。）及びこのうち次に掲げるポートフォリオごとの額
(1)　標準的手法が適用されるポートフォリオ及び標準的手法が複数のポートフォリオに適用される場合における適切なポートフォリオの区分ごとの内訳
(2)　内部格付手法が適用されるポートフォリオ及びこのうち次に掲げるポートフォリオごとの内訳（(v)及び(vi)に掲げるポートフォリオについて、信用リスクに関するエクスポージャー全体に占めるこれらのポートフォリオの割合が少なく、かつ、これらのポートフォリオのリスク特性が類似しており、預金者等による銀行のリテール業務のリスク特性の理解に支障が生じないと判断できる場合には、両者を区別して開示することを要しない。）
(i)　事業法人向けエクスポージャー
(ii)　ソブリン向けエクスポージャー
(iii)　金融機関等向けエクスポージャー
(iv)　居住用不動産向けエクスポージャー
(v)　適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー
(vi)　その他リテール向けエクスポージャー
(3)　証券化エクスポージャー
ロ　内部格付手法が適用される株式等エクスポージャーに係る信用リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち次に掲げる区分ごとの額
(1)　マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー及びこのうち次に掲げる区分ごとの内訳
(i)　簡易手法が適用される株式等エクスポージャー
(ii)　内部モデル手法が適用される株式等エクスポージャー
(2)　PD／LGD方式が適用される株式等エクスポージャー
ハ　信用リスク・アセットのみなし計算（自己資本比率告示第百六十七条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。以下この条、第四条、第十条及び第十二条において同じ。）が適用されるエクスポージャーに係る信用リスクに対する所要自己資本の額
ニ　マーケット・リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち銀行が使用する次に掲げる方式ごとの額
(1)　標準的方式（金利リスク、株式リスク、外国為替リスク、コモディティ・リスク及びオプション取引のカテゴリーごとに開示することを要する。）
(2)　内部モデル方式
ホ　オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち銀行が使用する次に掲げる手法ごとの額
(1)　基礎的手法
(2)　粗利益配分手法
(3)　先進的計測手法
ヘ　単体総所要自己資本額（自己資本比率告示第十四条各号の算式の分母の額に八パーセントを乗じた額をいう。第六条第一項第七号において同じ。）
二　信用リスク（信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く。）に関する次に掲げる事項
イ　信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高（期末残高がその期のリスク・ポジションから大幅に乖離している場合には、期中平均残高の開示も要する。）及びエクスポージャーの主な種類別の内訳
ロ　信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高のうち、次に掲げる区分ごとの額及びそれらのエクスポージャーの主な種類別の内訳
(1)　地域別
(2)　業種別又は取引相手の別
(3)　残存期間別
ハ　三月以上延滞エクスポージャーの期末残高又はデフォルトしたエクスポージャーの期末残高及びこれらの次に掲げる区分ごとの内訳
(1)　地域別
(2)　業種別又は取引相手の別