十一　自己資本比率告示第三条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表の各科目の額及びこれら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二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　その他金融機関等（自己資本比率告示第八条第八項第一号に規定するその他金融機関等をいう。）であって銀行の子法人等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社の名称と所要自己資本を下回った額の総額

二　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、預金者等による連結グループ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連結グループ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