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、預金者等による持株会社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（持株自己資本比率告示第百四十五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。以下この条及び第十五条において同じ。）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持株会社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

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持株会社グループ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　連結総所要自己資本額（持株自己資本比率告示第二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。第九条第一項第七号において同じ。）