(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a　項番１から項番５までの項には、商品ごとの想定元本の額を記載すること。

b　項番６「想定元本合計」の項には、項番１から項番５までの項に計上される額の合計額を記載すること。

c　項番７「プラスの公正価値（資産）」及び項番８「マイナスの公正価値（負債）」の項には、それぞれ正の時価の合計額及び負の時価の合計額を記載すること。

d　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「―」を記載すること。

e　この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。

（第十六面）

（単位：百万円）

ＣＣＲ８：中央清算機関向けエクスポージャー

項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）		
3	(i)派生商品取引（上場以外）		
4	(ii)派生商品取引（上場）		
5	(iii)レポ形式の取引		
6	(iv)クロスプロダクト・ネッティングが承認された場合のネッティング・セット		
7	分別管理されている当初証拠金		
8	分別管理されていない当初証拠金		
9	事前拠出された清算基金		
10	未拠出の清算基金		
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）		
13	(i)派生商品取引（上場以外）		
14	(ii)派生商品取引（上場）		
15	(iii)レポ形式の取引		
16	(iv)クロスプロダクト・ネッティングが承認された場合のネッティング・セット		
17	分別管理されている当初証拠金		
18	分別管理されていない当初証拠金		
19	事前拠出された清算基金		
20	未拠出の清算基金		

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a　項番１「適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項には、項番２、項番８、項番９及び項番10に計上される額の合計額を記載すること。

b　項番２から項番６までの「適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）」の項には、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の七第二項第一号に規定する適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー並びに連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の七第二項第二号及び第三項に規定する直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーに係る計数を、該当する項目ごとにそれぞれ記載すること。

c　項番７及び項番17「分別管理されている当初証拠金」の項には、中央清算機関以外の第三者において分別管理されており、かつ、中央清算機関に係る倒産手続又は外国における倒産手続と同種類の手続に伴う当該担保に対する損失の発生を防ぐために必要な方策が講ぜられている差入当初証拠金の額を記載すること。

d　項番８及び項番18「分別管理されていない当初証拠金」の項には、項番７及び項番17に該当するもの以外の差入当初証拠金に係る額を記載すること。

e　項番９及び項番19「事前拠出された清算基金」の項には、清算基金のうち、報告基準日時点までに拠出している額に係る額を記載すること。

f　項番10及び項番20「未拠出の清算基金」の項には、清算基金のうち、報告基準日時点において未拠出の額を記載すること。ただし、額が定まっていない場合には、各項を空欄とするとともに、額が定まっていない理由の説明を付すこと。

g　項番11「非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項には、項番12、項番18、項番19及び項番20に計上される額の合計額を記載すること。

h　項番12から項番16までの「非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）」の項には、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の七第一項に規定する中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（ただし、適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャーを除き、自金融機関が中央清算機関（適格中央清算機関を除く。）の間接清算参加者である場合には、直接清算参加者向けトレード・エクスポージャーを含む。）に係る計数を、該当する項目ごとに記載すること。

i　項番１「適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額及び項番11「非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額、第十面の項番６「合計」の項ヘ欄の額並びに第十一面の項番５「ＣＶＡリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計」の項ロ欄の額の合計額は、第一面の項番４「カウンターパーティ信用リスク」の項イ欄の額と一致する。

j　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「―」を記載すること。

k　この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。