⑵　原資産を構成するエクスポージャーのうち、三月以上延滞エクスポージャーの額又はデフォルトしたエクスポージャーの額及び当期の損失額並びにこれらの主な原資産の種類別の内訳（ただし、商工組合中央金庫が証券化エクスポージャーを保有しない証券化取引の原資産については、当期の証券化取引に係るものに限る。）

⑶　証券化取引を目的として保有している資産の額及びこれらの主な資産の種類別の内訳

⑷　当期に証券化取引を行ったエクスポージャーの概略（当期に証券化取引を行ったエクスポージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳を含む。）

⑸　証券化取引に伴い当期中に認識した売却損益の額及び主な原資産の種類別の内訳

⑹　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。）

⑺　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。）

⑻　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

⑼　自己資本比率告示第二百三十条第一項の規定により千二百五十パーセントのリスク・ウェイトが適用され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

⑽　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。）

ⓘ　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

ⓘⓘ　商工組合中央金庫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

ⓘⓘⓘ　商工組合中央金庫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

⑾　保有する再証券化エクスポージャーに対する信用リスク削減手法の適用の有無及び保証人ごと又は当該保証人に適用されるリスク・ウェイトの区分ごとの内訳

ロ　商工組合中央金庫が投資家である場合における信用リスク・アセット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

⑴　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。）

⑵　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。）

⑶　自己資本比率告示第二百三十条第一項の規定により千二百五十パーセントのリスク・ウェイトが適用され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

⑷　保有する再証券化エクスポージャーに対する信用リスク削減手法の適用の有無及び保証人ごと又は当該保証人に適用されるリスク・ウェイトの区分ごとの内訳