（第十八面）
（単位：百万円）

ＣＣＲ５：担保の内訳

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金（国内通貨）						
2	現金（外国通貨）						
3	国内ソブリン債						
4	その他ソブリン債						
5	政府関係機関債						
6	社債						
7	株式						
8	その他担保						
9	合計						

(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、自己資本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　この面においては、自金融機関が行う派生商品取引又はレポ形式の取引において使用される担保の額につき、自己資本比率告示第四章第六節第三款第二目に定める標準的ボラティリティ調整率（エクスポージャーと担保の通貨が異なる場合に適用するボラティリティ調整率を除く。）を勘案した後の額を記載すること（イ欄、ロ欄及びホ欄にはボラティリティ調整率を控除した後の額を、ハ欄、ニ欄及びヘ欄にはボラティリティ調整率を加算した後の額をそれぞれ記載すること。）。

b　イ欄及びハ欄には、取引相手方以外の第三者において分別管理されており、かつ、取引相手方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担保に係る額を記載すること。

c　ロ欄及びニ欄には、イ欄及びハ欄に該当するもの以外の担保に係る額を記載すること。

d　ホ欄及びヘ欄には、レポ形式の取引で使用する担保について現金及び有価証券の双方の額（超過担保を差し入れている場合又は受け入れている場合には、超過額を含めた額）をそれぞれ記載すること。

e　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。

f　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。

（第十九面）
（単位：百万円）

ＣＣＲ６：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

項番		イ	ロ
		購入したプロテクション	提供したプロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ		
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ		
3	トータル・リターン・スワップ		
4	クレジットオプション		
5	その他のクレジット・デリバティブ		
6	想定元本合計		
	公正価値		
7	プラスの公正価値（資産）		
8	マイナスの公正価値（負債）		

(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、自己資本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。

（第二十面）

ＣＣＲ７：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

項番			信用リスク・アセットの額
1	前期末時点における信用リスク・アセットの額		
2		資産の規模	