リ　次に掲げる有価証券（流動性が高いと認められるものを除く。）の残高の合計額

(1)　売買目的有価証券

(2)　その他有価証券

ヌ　観察可能な市場データ以外の情報に基づき公正価値評価された資産の残高

ル　対外与信の残高

ヲ　対外債務の残高

5　第一項の定量的な開示事項は、前項に掲げる事項のほか、別紙様式第二号（連結自己資本比率を算出する場合にあっては、第一面及び第三十面に限る。）により作成するものとする。

イ　標準的手法又は基礎的内部格付手法（内部格付手法のうち、事業法人等向けエクスポージャーについてＬＧＤ及びＥＡＤの自金庫推計値を用いない手法をいう。以下同じ。）が適用されるポートフォリオについて、次に掲げる信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー（信用リスク削減手法の効果が勘案された部分に限る。）の額（包括的手法を採用し、かつ、ボラティリティ調整率によるエクスポージャーの額の上方調整を行っている場合は、当該上方調整額に相当する額を減額した額）（基礎的内部格付手法が適用されるポートフォリオについては、事業法人向けエクスポージャー、ソブリン向けエクスポージャー及び金融機関等向けエクスポージャーごとに開示することを要する。）

(1)　適格金融資産担保

(2)　適格資産担保（基礎的内部格付手法が適用されるポートフォリオに係るものに限る。）

ロ　標準的手法又は内部格付手法が適用されるポートフォリオについて、保証又はクレジット・デリバティブが適用されたエクスポージャー（信用リスク削減手法の効果が勘案された部分に限る。）の額（内部格付手法が適用されるポートフォリオについては、事業法人向けエクスポージャー、ソブリン向けエクスポージャー、金融機関等向けエクスポージャー、居住用不動産向けエクスポージャー、適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー及びその他リテール向けエクスポージャーごとに開示することを要する。）

四　派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する次に掲げる事項

イ　与信相当額の算出に用いる方式

ロ　グロス再構築コストの額（零を下回らないものに限る。）の合計額

ハ　担保による信用リスク削減手法の効果を勘案する前の与信相当額（派生商品取引にあっては、取引の区分ごとの与信相当額を含む。）

ニ　ロに掲げる合計額及びグロスのアドオンの合計額からハに掲げる額を差し引いた額（カレント・エクスポージャー方式を用いる場合に限る。）

ホ　担保の種類別の額

ヘ　担保による信用リスク削減手法の効果を勘案した後の与信相当額

ト　与信相当額算出の対象となるクレジット・デリバティブの想定元本額をクレジット・デリバティブの種類別、かつ、プロテクションの購入又は提供の別に区分した額

チ　信用リスク削減手法の効果を勘案するために用いているクレジット・デリバティブの想定元本額

五　証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項

イ　農林中央金庫がオリジネーター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

(1)　原資産の合計額、資産譲渡型証券化取引に係る原資産及び合成型証券化取引に係る原資産の額並びにこれらの主な原資産の種類別の内訳（ただし、農林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。）

(2)　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、農林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。）