定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第六項及び第十八項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第六項及び第十八項の規定により算出する額を、ニ欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

b　平成三十年金融庁告示第十三号附則第二条第一項又は第四条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・エクスポージャー方式を用いる場合には、項番１と項番２との間に「カレント・エクスポージャー方式」との名称の項(項番を付さないこと。)を追加すること。この場合において、当該項には、自己資本比率告示第七十九条の四の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第三項各号に掲げる額をそれぞれ記載し、ハ欄及びニ欄については斜線を付すこと。

c　項番２「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三の規定により期待エクスポージャー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の三第二項第一号の算式において用いるαを又は自己資本比率告示第七十九条の三第四項の規定若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の三第四項の規定により独自に推計したαを、それぞれ記載すること。

［ｄ～ｆ　略］

ｇ　項番６「合計」の項へ欄には、項番１から項番５までの項へ欄の合計額を記載すること。ただし、ｂにより項を追加した場合にあっては、当該項のへ欄の額を当該合計額に加算した額を記載すること。

［ｈ～ｋ　略］

（第十一面）

［表略］

(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、自己資本比率告示及び持株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「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のＣＶＡリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の三又は持株自己資本比率告示第五十七条の三に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

［ｂ～ｉ　略］

率告示第七十九条の二第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第三項各号に掲げる額を、それぞれ記載すること。

b　項番１－２「標準方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三の規定により標準方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第一項第一号又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第一項第一号の算式において1.4を乗ずる前の額を、ニ欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

c　項番２「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四の規定により期待エクスポージャー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項第一号の算式において用いるαを又は自己資本比率告示第七十九条の四第四項の規定若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の四第四項の規定により独自に推計したαを、それぞれ記載すること。

［ｄ～ｆ　同左］

ｇ　項番６「合計」の項へ欄には、項番１－１から項番５までの項へ欄の合計額を記載すること。

［ｈ～ｋ　同左］

（第十一面）

［同左］

(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、自己資本比率告示及び持株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「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のＣＶＡリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の四又は持株自己資本比率告示第五十七条の四に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

［ｂ～ｉ　同左］