保険業法施行規則 第210条の10の2、銀行法施行規則 第34条の26、 平成26年金融庁告示 第7号 第15条、平成24年金融庁告示 第21号 に基づく開示項目と掲載ページ

保険業法施行規則 第210条の10の2

1.	保險			
	7	経営の組織(保険持株会社の子会社等(法第271条の25第1項前段に規定する説明書類の内容に 重要な影響を与えない子会社等を除く。)の経営管理に係る体制を含む。)	81、84~	- 86
		資本金の額及び発行済株式の総数		84
	/\	持株数の多い順に十以上の株主に関する次に掲げる事項		
		(1)氏名(株主が法人その他の団体である場合には、その名称)		
		(2) 各株主の持株数		84
		(3)発行済株式の総数に占める各株主の持株数の割合		
	=	取締役及び監査役(監査等委員会設置会社にあっては取締役、指名委員会等設置会社にあっては取締役及び執行役)の氏名 及び役職名		85
	木	会計参与設置会社にあっては、会計参与の氏名又は名称		_
	\wedge	会計監査人の氏名又は名称		100
2.	保险	 转株会社及びその子会社等の概況に関する次に掲げる事項		
	1	保険持株会社及びその子会社等の主要な事業の内容及び組織の構成 2 、 $28\sim38$ 、 86 、	91、94、	97
		保険持株会社の子会社等に関する次に掲げる事項		
		(1)名称		
		(2)主たる営業所又は事業所の所在地		
		(3)資本金又は出資金の額		
		(4)事業の内容	87 ~	- 88
		(5)設立年月日		
		(6)保険持株会社が保有する子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合		
		(7)保険持株会社の一の子会社等以外の子会社等が保有する当該一の子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合		
3.	保險	食持株会社及びその子会社等の主要な業務に関する事項として次に掲げるもの		
	1	直近の営業又は事業年度における事業の概況	28 ~	- 38
		直近の五連結会計年度における主要な業務の状況を示す指標として次に掲げる事項		
		(1)経常収益		
		(2)経常利益又は経常損失		
		(3)親会社株主に帰属する当期純利益又は親会社株主に帰属する当期純損失		
		(4) 包括利益	98 ~	- 99
		(5)純資産額		
		(6)総資産額		
		(7)保険金等の支払能力の充実の状況を示す比率		
4.	保険	美持株会社及びその子会社等の直近の二連結会計年度における財産の状況に関する次に掲げる事項		
	1	連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書	100~	103
	_	貸付金のうち次に掲げるものの額及びその合計額		
		(1)破綻先債権に該当する貸付金		
		(2)延滞債権に該当する貸付金		
		(3) 三カ月以上延滞債権に該当する貸付金		105
		(4)貸付条件緩和債権に該当する貸付金		
	/\	保険金等の支払能力の充実の状況(法第271条の28の2各号に掲げる額に係る細目として別表に掲げる額を含む。)及び保険持株会社の子会社等である保険会社の保険金等の支払能力の充実の状況(法第130条各号に掲げる額を含む。)	129、	130
	Ξ	保険持株会社及びその子法人等が二以上の異なる種類の事業を営んでいる場合の事業の種類ごとの区分に従い、当該区分に属する経常収益の額、経常利益又は経常損失の額及び資産の額(以下この号において[経常収益等]という。)として算出したもの(各経常収益等の総額に占める割合が少ない場合を除く。)	106~	109
	ホ	保険持株会社が連結貸借対照表、連結損益計算書及び連結株主資本等変動計算書について金融商品取引法第193条の2(公認会計士又は監査法人による監査証明)の規定に基づき公認会計士又は監査法人の証明を受けている場合にはその旨		100
5.	事象場合	集年度の末日において、当該保険持株会社が将来にわたって事業活動を継続するとの前提に重要な疑義を生じさせるような 象又は状況その他当該保険持株会社の経営に重要な影響を及ぼす事象(以下この号において「重要事象等」という。)が存在する 合には、その旨及びその内容、当該重要事象等についての分析及び検討内容並びに当該重要事象等を解消し、又は改善する めの対応策の具体的内容		_

1.	銀行	- 持株会社の概況及び組織に関する次に掲げる事項	
	1	経営の組織(銀行持株会社の子会社等(法第52条の25に規定する子会社等(法第52条の29第1項 前段に規定する説明書類重要な影響を与えない子会社等を除く。)をいう。以下この項において同じ。)の経営管理に係る体制を含む。) 48~	の内容に 81、84 ~ 86
		資本金及び発行済株式の総数	84
	<i>/</i> \	持株数の多い順に十以上の株主に関する次に掲げる事項	
		(1)氏名(株主が法人その他の団体である場合には、その名称)	
		(2) 各株主の持株数	84
		(3)発行済株式の総数に占める各株主の持株数の割合	
		取締役及び監査役(監査等委員会設置会社にあっては取締役、指名委員会等設置会社にあっては取締役及び執行役)の氏名 及び役職名	85
	木	会計参与設置会社にあっては、会計参与の氏名又は名称	-
	$\overline{}$	会計監査人の氏名又は名称	100
	銀行	- 打井株会社及びその子会社等の概況に関する次に掲げる事項	
	1	銀行持株会社及びその子会社等の主要な事業の内容及び組織の構成 2、28~38、86、	91、94、9
		銀行持株会社の子会社等に関する次に掲げる事項	
		(1)名称	
		(2)主たる営業所又は事務所の所在地	
		(3)資本金又は出資金	
		(4)事業の内容	87 ~ 8
		(5)設立年月日	07 - 00
		(6)銀行持株会社が保有する子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占める割合 (7)銀行持株会社の一の子会社等以外の子会社等が保有する当該一の子会社等の議決権の総株主又は総出資者の議決権に占	
		める割合	
	銀行	万持株会社及びその子会社等の主要な業務に関する事項として次に掲げるもの	
	1	直近の中間事業年度又は事業年度における事業の概況	28 ~ 3
		直近の三中間連結会計年度及び二連結会計年度又は直近の五連結会計年度における主要な業務の状況を示す指標として次に 掲げる事項	
		(1)経常収益	
		(2) 経常利益又は経常損失	
		(3) 親会社株主に帰属する中間純利益若しくは親会社株主に帰属する中間純損失又は親会社株主に帰属する当期純利益若しくは親会社株主に帰属する当期純損失	98 ~ 90
		(4)包括利益	30 3.
		(5) 純資産額 (5) (5) (5) (5) (5) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7	
		(6) 総資産額	
		(7)連結自己資本比率	
	1	方持株会社及びその子会社等の直近の二中間連結会計年度又は二連結会計年度における財産の状況に関する次に掲げる事項 中間連結貸借対照表又は連結貸借対照表、中間連結損益計算書又は連結損益計算書及び中間連結株主資本等変動計算書又 は連結株主資本等変動計算書	100~103
		貸出金のうち次に掲げるものの額及びその合計額	
		(1)破綻先債権に該当する貸出金	
		(2)延滞債権に該当する貸出金	4.0
		(3)三カ月以上延滞債権に該当する貸出金	10!
		(4)貸出条件緩和債権に該当する貸出金	
	<i>/</i> \	自己資本の充実の状況について金融庁長官が別に定める事項	110 ~ 126
	Ξ	経営の健全性の状況について金融庁長官が別に定める事項(ハに掲げる事項を除く)	_
		銀行持株会社及びその子法人等が二以上の異なる種類の事業を営んでいる場合の事業の種類ごとの区分に従い、当該区分に属する経常収益の額、経常利益又は経常損失の額及び資産の額(以下この号において「経常収益等」という。)として算出	106~109
	^	したもの(各経常収益等の額の総額に占める割合が少ない場合を除く。) 法第52条の28第1項 の規定により作成した書面(同条第2項 の規定により作成された電磁的記録を含む。)について会社法 第396条第1項 による会計監査人の監査を受けている場合にはその旨	100
	<u> </u>	銀行持株会社が中間連結貸借対照表又は連結貸借対照表、中間連結損益計算書又は連結損益計算書及び中間連結株主資本等変動計算書又は連結株主資本等変動計算書について金融商品取引法第193条の2 の規定に基づき公認会計士又は監査法人の監査証明を受けている場合にはその旨	
	チ	連結自己資本比率及び連結レバレッジ比率の算定に関する外部監査を受けている場合にはその旨	_
	法第	等(報酬、賞与その他の職務執行の対価として銀行持株会社若しくはその子会社等から受ける財産上の利益又は労働基準 第11条に規定する賃金をいう。)に関する事項であって、銀行持株会社及びその子会社等の業務の運営又は財産の状況に重 3.影響を与えるものとして金融庁長官が別に定めるもの	
).	事業続す	(株) 音を与えるものとりとも配り (長台が所に定めるもの) 学年度の末日 (中間説明書類にあっては、中間事業年度の末日) において、当該銀行持株会社が将来にわたって事業活動を継 するとの前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況その他当該銀行持株会社の経営に重要な影響を及ぼす事象 (以 この号において「重要事象等」という。) が存在する場合には、その旨及びその内容、当該重要事象等についての分析及び検討 なびに当該重要事象等を解消し、又は改善するための対応策の具体的内容	_

2項	自己	資本の構成に関する開示事項	110~12
3項	 定性	的な開示事項	
1.	連結の	D範囲に関する次に掲げる事項	
		持株自己資本比率告示第15条の規定により連結自己資本比率を算出する対象となる会社の集団(以下「持株会社グループ」という。)に属する会社と会計連結範囲に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因	11
	点	- 特株会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容	11
		特株自己資本比率告示第21条が適用される金融業務を営む関連法人等の数並びに当該金融業務を営む関連法人等の名称、 貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	11
		特株会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び持株会社グループに属しない会社であって会 計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容	11
	ホ 扌	特株会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要	11
2.		資本調達手段(その額の全部又は一部が、持株自己資本比率告示第14条の算式におけるコア資本に係る基礎項目の額に含 3資本調達手段をいう。)の概要	11
3.	持株会	会社グループの自己資本の充実度に関する評価方法の概要	11
4.	信用!	リスクに関する次に掲げる事項	
	イリ	リスク管理の方針及び手続の概要	11
	口格	票準的手法が適用されるポートフォリオについて、次に掲げる事項	
	(1)リスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等の名称(使用する適格格付機関等を変更した場合には、その理由を 含む。)	11
	(2)エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等の名称	
	/\	9部格付手法が適用されるポートフォリオについて、次に掲げる事項 	
	(1)使用する内部格付手法の種類	
	()	2) 内部格付制度の概要	
	(:	3)次に掲げるポートフォリオごとの格付付与手続の概要((vi)及び(vii)に掲げるポートフォリオについて、信用リスクに関するエクスポージャー全体に占めるこれらのポートフォリオの割合が少なく、かつ、これらのポートフォリオのリスク特性が類似しており、預金者等による持株会社グループのリテール業務のリスク特性の理解に支障が生じないと判断できる場合には、両者を区別して開示することを要しない。) (i)事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権及び適格購入事業法人等向けエクスポージャーについて区別して開	
		では、またのでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これ	
		(i i) ソブリン向けエクスポージャー	
		(iii) 金融機関等向けエクスポージャー	
		(iv)株式等エクスポージャー (株式等エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出に PD/LGD 方式を適用する場合に限る。)	
		(v)居住用不動産向けエクスポージャー	
		(vi) 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	
		(vii) その他リテール向けエクスポージャー	
5.	信用!	リスク削減手法に関するリスク管理の方針及び手続の概要	11
6.	派生商	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リスク管理の方針及び手続の概要	11
7.	証券(ヒエクスポージャーに関する次に掲げる事項	
	イ!	リスク管理の方針及びリスク特性の概要	11
		特株自己資本比率告示第227条第4項第3号から第6号まで(持株自己資本比率告示第232条第2項及び第280条の4第1項 こおいて準用する場合を含む。)に規定する体制の整備及びその運用状況の概要	1
		信用リスク削減手法として証券化取引を用いる場合の方針 	1 '
	_ 1	X券化エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の算出に使用する方式の名称	1 '
		E券化エクスポージャーのマーケット・リスク相当額の算出に使用する方式の名称	11
		特株会社グループが証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合には、当該証券化目的導管体 D種類及び当該持株会社グループが当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別	11
	(特株会社グループの子法人等(連結子法人等を除く。)及び関連法人等のうち、当該持株会社グループが行った証券化取引 持株会社グループが証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む。)に係る証券化エクスポージャーを保有してい 5ものの名称	11
	チ ii	E券化取引に関する会計方針	11
		IF券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称(使用する適格格付機関を E更した場合には、その理由を含む。)	11
	ヌヷ	9部評価方式を用いている場合には、その概要	
		E量的な情報に重要な変更が生じた場合には、その内容	

		マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(持株自己資本比率告示第14条の算式にマーケット・リスク相当額に係る額を算入する場合に限る。)				
	1	リスク管理の方針及び手続の概要	_			
		マーケット・リスク相当額の算出に使用する方式の名称 (複数の方式を使用する場合には、業務の別、拠点の別又は個別リスク若しくは一般市場リスクの別に開示することを要する。)	_			
	/\	想定される保有期間及び保有期間が想定を超える蓋然性等を踏まえ、取引の特性に応じて適切に価格を評価するための方法	_			
	=	内部モデル方式を使用する場合における使用するモデルの概要並びにバック・テスティング及びストレス・テストの説明	_			
	木	追加的リスクを内部モデルで計測している場合には、当該内部モデルの概要	_			
	\wedge	包括的リスクを内部モデルで計測している場合には、当該内部モデルの概要	-			
	 	マーケット・リスクに対する自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法	_			
9. ;	オ/	ペレーショナル・リスクに関する次に掲げる事項				
	1	リスク管理の方針及び手続の概要	114			
		オペレーショナル・リスク相当額の算出に使用する手法の名称(部分的に先進的計測手法を使用する場合は、各手法の適用 範囲を含む。)	114			
	/\	先進的計測手法を使用する場合における次に掲げる事項				
		(1) 当該手法の概要	_			
		(2) 保険によるリスク削減の有無 (保険によるリスク削減を行った場合は、保険の利用方針と概要を含む。)				
10	. 出	出資等又は株式等エクスポージャーに関するリスク管理の方針及び手続の概要	114			
11	. 🖆	金利リスクに関する次に掲げる事項				
	1	リスク管理の方針及び手続の概要	114			
		持株会社グループが内部管理ト使用した金利リスク算定手法の概要	114			

第4項 定量的な開示事項

4垻	疋	量的な開示事項	
		D他金融機関等(持株自己資本比率告示第18条第6項第1号に規定するその他金融機関等をいう。)であって銀行持株会社の子 、等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社の名称と所要自己資本を下回った額の総額	115
2.	ĖΞ	- - - - - - - - - -	
	1	信用リスクに対する所要自己資本の額(口及びハの額を除く。)及びこのうち次に掲げるポートフォリオごとの額	
		(1) 標準的手法が適用されるポートフォリオ及び複数のポートフォリオに適用される場合における適切なポートフォリオの区分ごとの内訳	115
		(2)内部格付手法が適用されるポートフォリオ及びこのうち次に掲げるポートフォリオごとの内訳((v)及び(vi)に掲げるポートフォリオについて、信用リスクに関するエクスポージャー全体に占めるこれらのポートフォリオの割合が少なく、かつ、これらのポートフォリオのリスク特性が類似しており、預金者等による持株会社グループのリテール業務のリスク特性の理解に支障が生じないと判断できる場合には、両者を区別して開示することを要しない。)	
		(i)事業法人向けエクスポージャー	
		(i i) ソブリン向けエクスポージャー	_
		(iii) 金融機関等向けエクスポージャー	
		(iv)居住用不動産向けエクスポージャー	
		(v)適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	
		(vi) その他リテール向けエクスポージャー	
		(3)証券化エクスポージャー	116
		内部格付手法が適用される株式等エクスポージャーに係る信用リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち次に掲げる区分ごとの額	
		(1)マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー及びこのうち次に掲げる区分ごとの内訳	
		(i)簡易手法が適用される株式等エクスポージャー	
			_
		(2) PD/LGD 方式が適用される株式等エクスポージャー	
	/\	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーに係る信用リスクに対する所要自己資本の額	
	Ξ	マーケット・リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち持株会社グループが使用する次に掲げる方式ごとの額	
		(1) 標準的方式(金利リスク、株式リスク、外国為替リスク、コモディティ・リスク及びオプション取引のカテゴリーごと に開示することを要する。)	116
		(2)内部モデル方式	
	ホ	オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額及びこのうち持株会社グループが使用する次に掲げる手法ごとの額	
		(1)基礎的手法	116
		(2)粗利益配分手法	
		(3) 先進的計測手法	_
	^	連結総所要自己資本額(持株自己資本比率告示第14条の算式の分母の額に4パーセントを乗じた額をいう。第17条第1項 第3号において同じ。)	
		日リスク(信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く。)に関する次に ずる事項	
		信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高(期末残高がその期のリスク・ポジションから大幅に乖離している場合には、期中平均残高の開示も要する。)及びエクスポージャーの主な種類別の内訳	117 ~ 120
		信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高のうち、次に掲げる区分ごとの額及びそれらのエクスポージャーの主な種類 別の内訳	
		(1) 地域別	117
		(2)業種別又は取引相手の別	
		(3) 残存期間別	118
	/\	三月以上延滞エクスポージャーの期末残高又はデフォルトしたエクスポージャーの期末残高及びこれらの次に掲げる区分 ごとの内訳	
		(1) 地域別	119
		(2)業種別又は取引相手の別	
	=	一般貸倒引当金、個別貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定の期末残高及び期中の増減額(一般貸倒引当金及び個別貸倒引当金については、次に掲げる区分ごとの期末残高及び期中の増減額を含む。ただし、一般貸倒引当金について次に掲げる区分ごとの算定を行っていない場合には、区分ごとの開示を要しない。)	
		(1) 地域別	119
		(2)業種別又は取引相手の別	
	木	業種別又は取引相手の別の貸出金償却の額	119
	^	標準的手法が適用されるエクスポージャーについて、リスク・ウェイトの区分ごとの信用リスク削減手法の効果を勘案した後の残高(格付が付与されている信用供与の割合が信用供与の額全体の1パーセント未満である場合には、区分を要しない。) 並びに持株自己資本比率告示第57条の5第2項第2号、第155条の2第2項第2号及び第225条第1項(持株自己資本比率告示第103条、第105条及び第114条第1項において準用する場合に限る。) の規定により1,250パーセントのリスク・ウェイトが適用されるエクスポージャーの額	120

<u></u>	内部格付手法が適用されるエクスポージャーのうち、スロッティング・クライテリアに割り当てられた特定貸付債権及び マーケット・ベース方式の簡易手法が適用される株式等エクスポージャーについて、持株自己資本比率告示第131条第3項 及び第5項並びに第144条第4項に定めるリスク・ウェイトが適用される場合におけるリスク・ウェイトの区分ごとの残高		
チ	内部格付手法が適用されるポートフォリオについて、次に掲げるエクスポージャーの区分に応じ、それぞれ次に定める事項(信用リスク削減手法を用いた場合は、これを反映するものとする。)		
	(1) 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 債務者格付 ごとの PD の推計値、LGD の推計値(先進的内部格付手法を適用する場合は、デフォルトしたエクスポージャーに係る ELdefault を含む。) の加重平均値、リスク・ウェイトの加重平均値、オン・バランス資産項目の EAD の推計値及びオフ・バランス資産項目の EAD の推計値(先進的内部格付手法を適用する場合は、コミットメントの未引出額及び当該未引 出額に乗ずる掛目の推計値の加重平均値を含む。)		
	(2) PD/LGD 方式を適用する株式等エクスポージャー 債務者格付ごとの PD の推計値、リスク・ウェイトの加重平均値 及び残高		
	(3)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次のいずれかの事項		
	(i) プール単位での PD の推計値、LGD の推計値 (デフォルトしたエクスポージャーに係る ELdefault を含む。) の加重平均値、リスク・ウェイトの加重平均値、オン・バランス資産項目の EAD の推計値、オフ・バランス資産項目の EAD の推計値、コミットメントの未引出額及び当該未引出額に乗ずる掛目の推計値の加重平均値		
IJ	内部格付手法を適用する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、PD/LGD 方式を適用する株式等エクスポージャー、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の直前期における損失の実績値及び当該実績値と過去の実績値との対比並びに要因分析	_	
ヌ	内部格付手法を適用する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、PD/LGD 方式を適用する株式等エクスポージャー、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の長期にわたる損失額の推計値と実績値との対比	-	
信用リスク削減手法に関する次に掲げる事項			
7	標準的手法又は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、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	120	
	(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。)		
	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。)	120	
派生	上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		
1	与信相当額の算出に用いる方式	121	
	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	121	
/\	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。)	121	
	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		
Ξ	日にありるロ前級及びプロスのアドオブのロ前額がられたありる級を差しらいに級(ガレブド・エブスが一ジャーガ式を 用いる場合に限る。)	121	
_		121	
市	用いる場合に限る。)		
- ホ ヘ	用いる場合に限る。) 担保の種類別の額	121	

121

- 6. 証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項
 - イ 持株会社グループ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、持株会社グループ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、持株会社グループ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。)
 - (3) 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
 - (4) 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。)
 - (5)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
 - (6)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。)
 - (7)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。)
 - (8) 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
 - (9) 持株自己資本比率告示第225条第1項の規定により1,250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
 - (10)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。)
 - (i)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
 - (ii) 持株会社グループ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
 - (iii) 持株会社グループ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
 - (11)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
 - □ 持株会社グループ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
 - (1)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。)
 - (2)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。)
 - (3) 持株自己資本比率告示第225条第1項の規定により1,250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
 - (4)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

日本郵政グループ 統合報告書 2019

ジャーに関するがに掲げる事項 (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部化からに残るとのに限る。) (2) 証券化取引を開かとして発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部化取引の原資産については、当期の証券化取引を所すとして発有している資産の類及びこれらの主な資産の種類別の内部とおおいる場所の内部とおおいる。) (3) 当期に証券化取引を行ったエクスポージャーの報路(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部とおおいる。) (4) 証券化取引に作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部と有する証券化エクスポージャーの可及び主な原資産の種類別の内部とおおいる。) (5) 保有する証券化エクスポージャーの商及び主な原資産の種類別の内部(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。) (7) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総別が主な原資産の種類別の内部と己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内部 (8) 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部(9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において調み替えて単非する主要とな原資産の種類別の内部(9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において調み替えて単非する主要とないまかまります。 (6) 早期機選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部を含む。) (7) 早期機選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部を含む。) (8) 非株会社グルーブがオリジネーターとして留保する早期優選条項付の証券化エクスポージャーを対象とする実行済か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自分的の言語に対する原理自己資本の額(前) 持株会社グルーブが投資率の対分に対しまして記載することの適の合語値に対する原理自己資本の額の信用性与の額及び想定元本額の未実行の部分の信用供与額の自己の部の合語値に対する原理自己資本の額の事る次に提げる事項(1) 保有する証券化エクスポージャーの額及びまな原資産の種類別の内部を自己資本の額(再証券化エクスポージャーに対して記載することを要する。) (9) 保有する証券化エクスポージャーの額及びまな原資産の種類別の内部で自己資本の額の内部では自己資本の混りスクので要目の主要をの場の内部では同じ対象のの別のに同じ、20 保有する認知の以取録となる証券化エクスポージャーの額及び最近の日の別のの記録といるので、20 保有する場所の日の記録としてので、20 保有する額のの別のに関する記述のに関する場所の日の記述との表に関するののので、20 保有する認知のよりに対するといので、20 保有する認知のの別のに関するに関する場所の内部を行まの記録となる記述がに関する場合に関する場所の内部を行まの記述がに関する場所の内部を行まの表に関する記述がに関する場合に関する場所の内部を行まの表に関する。20 保有する証券のよりに関するに関する場所の内部を行まの表に関する。20 保有する証券のよりに関するに関するといれての記述を対象を行まれての記述を行まれています。20 保有が関するに関するといれていまがに関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が定式を対象を表する。20 保有が可能のの表に対象を表する。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有が関するといれています。20 保有がでいれています。20 保有が関するといれていまれています。20 保有がでは、20 保有がでは、20 保有がでは、20 保有がでいれています。20 保有がでいれていれています。20 保有	
は、当期の証券化取引に係るものに限る。) (2) 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 (3) 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順資産の種類別の内訳を含む。) (4) 証券化取引に伴い当期中に認識した売却接述の額及び主な原資産の種類別の内訳 (5) 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。) (6) 保有する証券化エクスポージャーの適な数のリスク・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。) (7) 包括のリスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (8) 証券化取引に伴い増加した已費本に担当する額及び主な原資産の種類別の内別 (9) 持株自己資本は中い増加した日ご資本に担当する額及び主な原資産の種類別の内別 (9) 持株自己資本はおいまのか替えて年用する持株自己資本比率告示第225条(第1到第2号を終く。)の規定により100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別 (10) 早期偿置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の額の部の合計額に対する所要自己資本の額(川) 持株会社グループが投資家の持分に対して管理する早期偿置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を入の配金の計画に対する所要自己資本の額(川) 持株会社グループが投資家の持分に対して管理する中に関係の原理対象となる証券化エクスポージャーに関するの信用が多なに関付る事項 (1) 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(用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。) (3) 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及び通切なリスクの計画対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額の内別 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第、3項において読み替えて率用する持株自己資本比率告示第225条(第1]第第2号を除く、)の規定により100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部 (4) 将来の意とまを要する。 (4) 将来の可以を任めで関本の類に対するがに対するがに対するがに対するがに対するがに対するがに対するがに対する所要自己資本の額の内別 (5) 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海運用の対象となる証券化エクスポージャーに対する所要自己資本の額の方式とな原資産の種類別の内別(1) 保有する証券化エクスポージャーの適切な数のリスクの計画対象となる証券化エクスポージャーの認及び連定の額と対する所要自己資本の額の対するがに対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対するに対する所では対する所では対する所では対する所では対する所では対するに対するに対する所では対するに対するに対するに対するに対するに対するに対するに対するに対するに対するに	
(3) 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。) (4) 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 (5) 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 (用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。) (6) 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(雨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。) (7) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総類並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (8) 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 (9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において法み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により1100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 (10) 早期償園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。) (1) 早期償園条項付の証券化エクスポージャーを対象とする早期信題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規定元本額の未実行の部分の信用供与額のとわりの額の合計額に対する所要自己資本の額(前)持株会社グループが投資家であると対して需せる早期信選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規定元本部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(前)持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額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) (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及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内別 (4) 持株自己資本比率告示第20条の予定2項において読み音気で単する場合に限る。) (7) マーケット・リスクの目測対象となる証券化エクスポージャーの額及び達な原資産の種類別の内別 (4) 持株自己資本比率告示第20条の予定2項において読み音気で用する場合に取る。) (5) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの額及び達な原資産の種類別の内別 (5) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの適及び適切なリスクの種類別の内別 (7) マーケット・リスクの計測する次に原本が関目における記分に用示す自己資本の額及び過程の更高、平均及び最低の質	
(4)証券に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 (5) 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ごとを要する。) (6) 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。) (7) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (8) 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 (9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において充動が替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除ぐ。)の規定により100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 (10) 早期償週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。) (1) 早期償週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(1) 持株会社グループがオリジネーターとして留保する早期償週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額のEAD の額の分割をは入リープが対象とする実行済みの信用供与額のEAD の額の合計館に対する所要自己資本の額(川) 持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーにの助して開出するの部分の信用性与額の手間の対する所要自己資本の額と対象に本額の未実行の部分の信用性与額の原の合計額に対する所要自己資本の額を対象における事項(1) 保有する証券化エクスポージャーの超及び建定本額のキ実行の部分の信用性与のののの合計額に対する所要自己資本の額(再証券化エクスポージャーにのいて区別して記載することを要する。) (2) 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(1) 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 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除念)の規定により100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 (4) 持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除念)の規定に対する取引の内訳 (4) 非本の定し資本の第のの内訳 (4) 非本のアルーアット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 明末のストレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 1 期末のストレス・パリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるぶりのリスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額をがにリスクに係るが要自己資本の最高、平均及び最低の額 1 バック・テスティングの結果及び損益の実績値がパリュー・アット・リスクの値から大幅に下方系離した場合にいての	
(5)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。) (6)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。) (7)包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の付款 (8)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 (9) 所株自己資本比率告示第280条の5第2頃において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1頃第2号を除く。)の規定により100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権類別の内訳 (10)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 (11)持株会社グループ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は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(iii)持株会社グループが対党資家の持分に対して買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表行済みの信用供与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(iii)持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の専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)保有する証券化エクスポージャーの適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。) (2)保有する証券化エクスポージャーの適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の額及び主な原資産の種類別の所要自己資本の額の内訳 (4)持株自己資本レンスプロジを含む。2000年で、1000年	
 職することを要する。) (6)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。) (7)包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (8) 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 (9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 (10) 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。) (11) 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額のにおけっての記念が上フスポージャーを対象とする実行済みの信用供与額の及び銀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(ii) 持株会社グループ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(ii) 持株会社グループが投資家のあ場合におけるマーケット・リスク相当額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 (11) 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。) (2) 保有する配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。) (3) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額の内訳 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第25条(第1項第2号を除く、)の規定により100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部 (4) 7 平内の利用における次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のパレュ・アット・リスクの値並びに開示期間における場合に限る。) イ 期末のパレュ・アット・リスクの値並びに開示期間における2トレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 リ 期末のパレュ・アット・リスクの値並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最近が同意を開かしまがに関示する場合に対しるがでに関示期間における追加のリスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加のリスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最近が同意がよれている。 7 マケット・リスクの経過がに関示期間における2トレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び包括のリスクに優高の確立がに関示期間における2トレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び包括のリスクに受害の認定が同意がよれている。 6 期末のパリスクの記録がは、2 アウスが自然を表する。 7 アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・アクス・	
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。) (7) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内駅 (8) 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駅 (9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2頃において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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駅 (10) 早期償園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駅を含む。) (1) 早期償園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額の10円の10円の10円の10円の10円の10円の10円の10円の10円の10円	
(8) 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駅 (9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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駅 (10) 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駅を含む。) (i) 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 (ii) 持株会社グループ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 (iii) 持株会社グループ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 こ 持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額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) 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。) (2) 保有する証券化エクスポージャーの適切な数のリスク・ウェイトの区分で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。) (3) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の内限 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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適切なリスクを確類別の内限	
(9) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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限 (10) 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限を含む。) (1) 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 (11) 持株会社グループ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 (iii) 持株会社グループ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 ニ 持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額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) 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。) (2) 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。) (3) 保有するご括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内別 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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別 7. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のパリュー・アット・リスクの値並びに開示期間における場合に限る。 「期末のパリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるよりレス・パリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 「期末のストレス・パリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるよりに下方乖離した場合についての係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額	-
除く。)の規定により100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 (10)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。) (1)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 (ii)持株会社グループ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 (iii)持株会社グループが投資家の持分に対して第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	
(i)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 (ii)持株会社グループ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 (iii)持株会社グループ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	
(i) 持株会社グループ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 (iii) 持株会社グループ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	
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 (iii) 持株会社グループ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	
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 一 持株会社グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額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)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。) (2)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。) (3)保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (4)持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	
する次に掲げる事項 (1)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。) (2)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。) (3)保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (4)持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 7. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 □ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	
 載することを要する。) (2)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。) (3)保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (4)持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ロ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての 	
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。) (3) 保有する包括的リスクの計測対象となる証券化エクスポージャーの総額並びに所要自己資本の額及び適切なリスクの種類別の所要自己資本の額の内訳 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 7. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 □ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	
種類別の所要自己資本の額の内訳 (4) 持株自己資本比率告示第280条の5第2項において読み替えて準用する持株自己資本比率告示第225条(第1項第2号を除く。)の規定により100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 7. マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ロ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	
除く。)の規定により100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 ・マーケット・リスクに関する次に掲げる事項(内部モデル方式を使用する場合に限る。) イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ロ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額高、平均及び最低の額 エ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	-
 イ 期末のバリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるバリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ロ 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての 	
 期末のストレス・バリュー・アット・リスクの値並びに開示期間におけるストレス・バリュー・アット・リスクの最高、平均及び最低の値 が期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての 	
平均及び最低の値 ハ 期末の追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の額並びに開示期間における追加的リスク及び包括的リスクに係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	12
係る所要自己資本の最高、平均及び最低の額 ニ バック・テスティングの結果及び損益の実績値がバリュー・アット・リスクの値から大幅に下方乖離した場合についての	12
	12
בפיום	12
. 出資等又は株式等エクスポージャーに関する次に掲げる事項	
イ 連結貸借対照表計上額及び時価並びに次に掲げる事項に係る連結貸借対照表計上額	
(1)上場株式等エクスポージャー	12
(2)上場株式等エクスポージャーに該当しない出資等又は株式等エクスポージャー	12
ロ 出資等又は株式等エクスポージャーの売却及び償却に伴う損益の額	12
ハ 連結貸借対照表で認識され、かつ、連結損益計算書で認識されない評価損益の額	12
二 連結貸借対照表及び連結損益計算書で認識されない評価損益の額	
ホ 株式等エクスポージャーのポートフォリオの区分ごとの額	12
. 信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額	12:

10. 金利リスクに関して持株会社グループが内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済的価値の増減額

123

平成24年3月29日 金融庁告示第21号 第3条

銀行持株会計等の	お子 は はんしょう はんしゅう はんしゅう はんしゅう しゅうしゅう はんしゅう はんしゅう はんしゅう はんしゅう はんしゅう しゅう はんしゅう しゅう しゅう しゅう しゅう しゅう しゅう しゅう しゅう しゅう	オス開示車佰

1.	対象役員(銀行持株会社の取締役(社外取締役を除くことができる。)、執行役、会計参与及び監査役(社外監査役を除くことができる。)をいい、直近の事業年度中に退任した者を含む。)及び対象従業員等(銀行持株会社の対象役員以外の役員及び従業員並びにその主要な連結子法人等(規則第35条第3項第15号に規定する連結子法人等をいう。)の役員及び従業員(直近の事業年度中に退任又は退職した者を含む。)であって、銀行持株会社又はその主要な連結子法人等から高額の報酬等(報酬、賞与その他の職務執行の対価として銀行持株会社若しくはその主要な連結子法人等から受ける財産上の利益又は労働基準法第11条に規定する賃金をいう。)を受ける者のうち、銀行持株会社及びその主要な連結子法人等の業務の運営又は財産の状況に重要な影響を与えるものをいう。)の報酬等の決定及び報酬等の支払その他の報酬等に関する業務執行の監督を行う委員会その他の主要な機関等の名称、構成及び職務に関する事項	127
2.	対象役員及び対象従業員等の報酬等の体系の設計及び運用の適切性の評価に関する事項	127
3.	対象役員及び対象従業員等の報酬等の体系とリスク管理の整合性並びに対象役員及び対象従業員等の報酬等と業績の連動に関 する事項	128
4.	対象役員及び対象従業員等の報酬等の種類、支払総額及び支払方法に関する事項	128
5.	前各号に掲げるもののほか、報酬等の体系に関し参考となるべき事項	128