

## 開示雛型の一覧

略称	開示内容	様式		開示頻度		
		指定	任意	四半期	財務諸表と 同頻度	年度毎
<b>① リスク管理・所要自己資本に係る概要</b>						
OVA	リスク評価・管理の全体像		✓			✓
OV1	RWAの主な内訳 (所要自己資本)	✓		✓		
<b>② 財務諸表と規制上のエクスポージャー</b>						
LI1	会計/規制上のB/S比較		✓			✓
LI2	銀行勘定/トレーディング勘定別B/S		✓			✓
LIA	会計/規制間の差異に関する 定性的説明		✓			✓
<b>③ 信用リスク</b>						
CRA	信用リスクに関する定性的説明		✓			✓
CR1	商品毎のエクスポージャー分析	✓			✓	
CR2	デフォルトしたローン・債券の残高推移	✓			✓	
CRB	信用リスクに関する補足説明		✓			✓
CRC	保証・担保等に関する 定性的説明		✓			✓
CR3	保証・担保等の概要	✓			✓	
CR4	被保証債権等とそのカバー率内訳	✓			✓	
CR5	被保証債権の保証人に係る 格付別内訳		✓		✓	
CR6	プロテクション対象債権のCDS等のカウン ター・パーティーの格付別内訳		✓		✓	
CRD	標準的手法 (SA) に関する 定性的説明		✓			✓
CR7	SA：信用リスクのエクスポージャーと 信用リスク削減 (CRM) 手法	✓		✓		
CR8	SA：資産クラスとリスク・ウェイト(RW)別 エクスポージャー	✓		✓		
CRE	内部格付手法 (IRB) に関する 定性的説明		✓			✓
CR9	IRB：ポートフォリオ/倒産確率 (PD) 別エクスポージャー	✓		✓		
CR10	IRB：CRM手法	✓		✓		
CR11	IRB：RWAの要因別フロー分析		✓		✓	
CR12	IRB：ポートフォリオ別PDに係る バックステイキング		✓			✓
CRF	特定貸付債権に関する 定性的説明		✓			✓
CR13	IRB：特定貸付債権・株式等 (規制上RWの利用)		✓	✓		

### 開示雛型の一覧（続き）

略称	開示内容	様式		開示頻度		
		指定	任意	四半期	財務諸表と同頻度	年度毎
<b>④ カウンターパーティー信用リスク</b>						
CCRA	カウンターパーティー信用リスク(CCR)の定性的説明		✓			✓
CCR1	手法毎のCCR内訳	✓		✓		
CCR2	信用評価調整(CVA)に係る所要自己資本	✓		✓		
CCR3	SA：資産クラス/RW別内訳	✓		✓		
CCR4	IRB：ポートフォリオ/PD別内訳	✓		✓		
CCR5	担保/商品別内訳		✓		✓	
CCR6	信用デリバティブ：種類/売買別内訳		✓		✓	
CCR7	RWA（内部モデル手法）の要因別フロー分析		✓		✓	
CCR8	中央清算機関向けエクスポージャー	✓		✓		
<b>⑤ 証券化</b>						
SECA	証券化に関する定性的説明		✓			✓
SEC1	銀行勘定の証券化取引（ストック）		✓		✓	
SEC2	銀行勘定の証券化取引（フロー）		✓		✓	
SEC3	トレーディング勘定の証券化取引（ストック）		✓		✓	
SEC4	トレーディング勘定の証券化取引（フロー）		✓		✓	
SEC5	オリジネーター/スポンサーとしての銀行勘定の証券化ポジション	✓		✓		
SEC6	投資家としての銀行勘定の証券化ポジション	✓		✓		
<b>⑥ 市場リスク</b>						
MRA	市場リスクに関する定性的説明		✓			✓
MRB	内部モデル(IMA)利用銀行による市場リスクに関する定性的説明		✓			✓
MR1	SA：内訳	✓		✓		
MR2	IMA：内訳	✓		✓		
MR3	キー・ドライバ別のRWA推移		✓		✓	
MR4	IMA：トレーディング・ポートフォリオ分析	✓		✓		
MR5	損益とVaR（バリュエ・アット・リスク）推計の比較		✓		✓	
合計		19	28	16	16	15

以 上