

○ 金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が自己資本の充実の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件（平成二十二年金融庁告示第百三十二号）

次の表により、改正前欄に掲げる規定の傍線を付し又は破線で囲んだ部分をこれに順次対応する改正後欄に掲げる規定の傍線を付し又は破線で囲んだ部分のように改め、改正前欄及び改正後欄に対応して掲げるその標記部分に二重傍線を付した規定（以下「対象規定」という。）は、その標記部分が同一のものは当該対象規定を改正後欄に掲げるもののように改め、その標記部分が異なるものは改正前欄に掲げる対象規定を改正後欄に掲げる対象規定として移動し、改正前欄に掲げる対象規定で改正後欄にこれに対応するものを掲げていないものは、これを削る。

改正後	改正前
<p>(事業年度の記載事項)</p> <p>第三条 「略」</p> <p>〔2・3 略〕</p> <p>4 「略」</p> <p>〔一〇三 略〕</p> <p>四 会社グループのうち、イの額を直前に終了した事業年度末の為替レートでユーロに換算して得られたものが二千億ユーロを超えるもの及びこれに準ずる会社グループとして金融庁長官が指定するものにあつては、次に掲げる事項</p> <p>イ 次に掲げる額の合計額</p> <p>(1) 「略」</p> <p>(2) デリバティブ取引等（先渡、スワップ、オプションその他の派生商品取引及び長期決済期間取引をいう。以下イにおいて同じ。）に関する額（デリバティブ取引等について算出したエクスポージャーの額（デリバティブ取引等について算出した再構築コストの額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）及びデリバティブ取引等についてカレント・エクスポージャー方式（銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準（平成十八年金</p>	<p>(事業年度の記載事項)</p> <p>第三条 「同上」</p> <p>〔2・3 同上〕</p> <p>4 「同上」</p> <p>〔一〇三 同上〕</p> <p>四 「同上」</p> <p>イ 「同上」</p> <p>(1) 「同上」</p> <p>(2) デリバティブ取引等（先渡、スワップ、オプションその他の派生商品取引及び長期決済期間取引をいう。以下イにおいて同じ。）に関する額（デリバティブ取引等について算出したエクスポージャーの額（デリバティブ取引等について算出した再構築コストの額（当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。）及びデリバティブ取引等についてカレント・エクスポージャー方式で計算したアドオンの額並びにプロテクションを提供するクレジット・デリバティブに係る想定元本の額の合計額をいう。）及びデリバティブ取引等に関連し</p>

融庁告示第十九号)第七十九条の四に定めるところにより与信相当額を算出する方式をいう。ロ及びハにおいて同じ。)で計算したアドオンの額並びにプロテクションを提供するクレジット・デリバティブに係る想定元本の額の合計額をいう。及びデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額の合計額をいう。)

〔(3)・(4) 略〕

〔ロ・ハ 略〕

〔5～7 略〕

て現金で差し入れた証拠金の対価の額の合計額をいう。)

〔(3)・(4) 同上〕

〔ロ・ハ 同上〕

〔5～7 同上〕

(別紙様式第二号)

(第一面)

(単位：百万円)

0V1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号	イ	ロ	ハ		ニ
			リスク・アセット	所要自己資本	
	当期末	前期末	当期末	前期末	
[略]					
4	カウンターパーティ信用リスク				
<u>5</u>	うち、 <u>SA-COR</u> 適用分				
[項を削る。]					
[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、連結自己資本規制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・b 略]

。 項番2「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第十四条に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合計額に8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面において

(別紙様式第二号)

(第一面)

(単位：百万円)

0V1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号	イ	ロ	ハ		ニ
			リスク・アセット	所要自己資本	
	当期末	前期末	当期末	前期末	
[同左]					
4	カウンターパーティ信用リスク				
<u>5-1</u>	うち、 <u>カレント・エクスポージャー</u> 方式適用分				
<u>5-2</u>	うち、標準方式適用分				
[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、連結自己資本規制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・b 同左]

。 項番2「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第十四条第一項に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合計額に8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面に

同じ。) (ハ欄及びニ欄) をそれぞれ記載すること。

【d～j 略】

k 項番 5 「カウンターパーテイ信用リスクのうち、SAA-COR適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率告示第三十四条第五項及び第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）並びにこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

1 銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当かどうかを判断するための基準等の一部を改正する件（平成三十年金融庁告示第十三号。第十四面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第十条第一項の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いる場合には、項番 5 と項番 6 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、カレント・エクスポージャー方式により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

【m～pp 略】

【(第二面)～(第六面) 略】
(第七面)

【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、連結自己資本規制比率告示に

おいて同じ。) (ハ欄及びニ欄) をそれぞれ記載すること。

【d～j 同左】

k 項番 5-1 「カウンターパーテイ信用リスクのうち、カレント・エクスポージャー方式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率告示第三十四条第五項及び第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）並びにこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

1 項番 5-2 「カウンターパーテイ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八条（連結自己資本規制比率告示第三十四条第五項及び第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

【m～pp 同左】

【(第二面)～(第六面) 同左】
(第七面)

【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、連結自己資本規制比率告示に

において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 略]

n 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、国際開発協会、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イスラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリティ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

[o～gg 略]

(第八面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～h 略]

i 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、国際開発協会、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行

において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 同左]

n 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イスラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリティ及び欧州評議会開発銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

[o～gg 同左]

(第八面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～h 同左]

i 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発

、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアシリナイ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。) 向けエクスポートファイナンスに係る額を記載すること。

[j～z 略]

【(第九面) ～ (第十三面) 略】
(第十四面)

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポートファイナンス額						
項番			ハ	ニ	ホ	ヘ
	イ	ロ				
1	再構築 コスト	アドオ ン	実効IP E	規制上 のエク スポー ジヤー の算定 に使用 される α	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー ジヤー	リスク ・アセ ットの 額
	SA-C CR			1.4		

銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアシリナイ及び欧州評議会開発銀行を含む。) 向けエクスポートファイナンスに係る額を記載すること。

[j～z 同左]

【(第九面) ～ (第十三面) 同左】
(第十四面)

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポートファイナンス額						
項番			ハ	ニ	ホ	ヘ
	イ	ロ				
1-1	再構築 コスト	アドオ ン	実効IP E	規制上 のエク スポー ジヤー の算定 に使用 される α	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー ジヤー	リスク ・アセ ットの 額
	カレント ・エクス ポート ファイナ ンス方式					

[項を削る。]
[略]

(注)

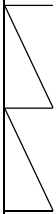
この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a 項番1「SA-CCR」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条の規定によりSA-CCRを用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七條第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七條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十條第一項の規定によりカレント・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、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、イ欄については平成三十年金融庁告示第十三号による改正前の連結自己資本規制比率告示第四十七條第一項第一号に掲げる額及び同條第二項に規定する額を、ロ欄については平成三十年金融庁告示第十三号による改正前の連結自己資本規制比率告示第四十七條第二号に掲げる額及び同條第三項に規定す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～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おいては、当該項へ欄の額を当該合計

1-2	標準方式		1.4	
[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、連結自己資本規制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1-1「カレント・エクスポージャー方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七條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、イ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七條第一項第一号に掲げる額及び同條第二項に規定する額を、ロ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七條第一項第二号に掲げる額及び同條第三項に規定する額を、それぞれ記載すること。

b 項番1-2「標準方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八條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、ハ欄については連結自己資本規制比率告示第四十八條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～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。

額に加算した額を記載すること。

【h～k 略】

【(第十五面) 略】

(第十六面)

【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、連結自己資本規制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～g 略】

h 項番6「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行(国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、アフリカ開発銀行、欧州投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、子防接種のための国際金融フアンリテイ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。)向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

【i～p 略】

【(第十七面)～(第三十面) 略】

(別紙様式第四号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要

【h～k 同左】

【(第十五面) 同左】

(第十六面)

【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、連結自己資本規制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～g 同左】

h 項番6「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行(国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、アフリカ開発銀行、欧州投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、子防接種のための国際金融フアンリテイ及び欧州評議会開発銀行を含む。)向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

【i～p 同左】

【(第十七面)～(第三十面) 同左】

(別紙様式第四号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要

国際様式 の該当番 号	イ		ロ		ハ		ニ	
	リスク・アセット 当中間 期末	前中間 期末	当中間 期末	前中間 期末				
[略]								
4	カウンターパーティー信用リスク							
5	うち、 <u>SARCCR</u> 適 用分							
[項を削る。]								
[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、連結自己資本規制比率告示に
おいて使用する用語の例によるものとする。

[a・b 略]

o 項番2 「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率
告示第十四条に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこ
れに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合計額に
8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面において
同じ。）（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[d～j 略]

k 項番5 「カウンターパーティー信用リスクのうち、SARCCR適用分」の項には、
連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率告示第三百三十四条第五

国際様式 の該当番 号	イ		ロ		ハ		ニ	
	リスク・アセット 当中間 期末	前中間 期末	当中間 期末	前中間 期末				
[同左]								
4	カウンターパーティー信用リスク							
5-1	うち、 <u>カレント・エク スポージヤ方式</u> 適 用分							
5-2	うち、標準方式適用分							
[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、連結自己資本規制比率告示に
おいて使用する用語の例によるものとする。

[a・b 同左]

o 項番2 「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率
告示第十四条第一項に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）
及びこれに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合
計額に8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面に
おいて同じ。）（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[d～j 同左]

k 項番5-1 「カウンターパーティー信用リスクのうち、カレント・エクスポージャー方
式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率

項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウエイトを乗じた額の合計額(イ欄及びロ欄)並びにこれに係る所要自己資本の額(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。

1 銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充塞の状況が適当かどうかを判断するための基準等の一部を改正する件(平成三十年金融庁告示第十三号。第十面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。)附則第十条第一項の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いる場合には、項番5と項番6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、カレント・エクスポージャー方式により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウエイトを乗じた額の合計額(イ欄及びロ欄)及びこれに係る所要自己資本の額(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。

[m～pp 略]

[(第二面)～(第四面) 略]

(第五面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー(リスク・ウエイトを直接に判定することができないものをいう。)に係る信用リスクは対象外とする。

告示第三百二十四条第五項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウエイトを乗じた額の合計額(イ欄及びロ欄)並びにこれに係る所要自己資本の額(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。

1 項番5-2「カウンターパーティ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八条(連結自己資本規制比率告示第三百二十四条第五項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウエイトを乗じた額の合計額(イ欄及びロ欄)及びこれに係る所要自己資本の額(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。

[m～pp 同左]

[(第二面)～(第四面) 同左]

(第五面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー(リスク・ウエイトを直接に判定することができないものをいう。)に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 略]

n 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、国際開発協会、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリテイ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

[o～gg 略]

(第六面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～h 略]

i 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、国際開発協会、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリテイ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

[a～m 同左]

n 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリテイ及び欧州評議会開発銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

[o～gg 同左]

(第六面)

【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、連結自己資本規制比率告示において使用する用語の例によるものとする。

この面においては、カウンターパーティ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク及び複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リスク・ウェイトを直接に判定することができないものをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～h 同左]

i 項番 7 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イヌラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシリテイ及び欧州評議会開発銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

【j～z 略】

【(第七面)～(第九面) 略】
(第十面)

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築 コスト	アトオ ン	実効EP E	規制上 のエク スポー ジヤー の算定 に使用 される α	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー ジヤー	リスク ・アセ ットの 額
<u>1</u>	<u>SA-C</u> <u>CR</u>				1.4		
[項を削る。]							
[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、連結自己資本規制比率告示に

【j～z 同左】

【(第七面)～(第九面) 同左】
(第十面)

(単位：百万円)

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築 コスト	アトオ ン	実効EP E	規制上 のエク スポー ジヤー の算定 に使用 される α	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー ジヤー	リスク ・アセ ットの 額
<u>1-1</u>	<u>カレント</u> <u>・エクス</u> <u>ポージヤ</u> <u>ー方式</u>				α		
<u>1-2</u>	<u>標準方式</u>				1.4		
[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、連結自己資本規制比率告示に

おいて使用する用語の例によるものとする。

a 項番 1 「SA-CCR」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条の規定により SA-CCR を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条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十条第一項の規定によりカレント・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、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、イ欄については平成三十年金融庁告示第十三号による改正前の連結自己資本規制比率告示第四十七条第一項第一号に掲げる額及び同条第二項に規定する額を、ロ欄については平成三十年金融庁告示第十三号による改正前の連結自己資本規制比率告示第四十七条第二号に掲げる額及び同条第三項に規定す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～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) 略】

(第十二面)

おいて使用する用語の例によるものとする。

a 項番 1-1 「カレント・エクスポージャー方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条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、イ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条第一号に掲げる額及び同条第二項に規定する額を、ロ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条第一項第二号に掲げる額及び同条第三項に規定する額を、それぞれ記載すること。

b 項番 1-2 「標準方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八条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、ハ欄については連結自己資本規制比率告示第四十八条第一項第一号の算式において 1.4 を乗する前の額を、ニ欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

[c～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】

(第十二面)

【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、連結自己資本規制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～g 略】

h 項番 6 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行(国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、国際開発協会、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イスラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシテイ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。)向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

【i～p 略】

【(第十三面)～(第二十四面) 略】

(別紙様式第六号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要				
国際株式 の該当番 号	イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本
	当四半 期末	前四半 期末	当四半 期末	前四半 期末

【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、連結自己資本規制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～g 同左】

h 項番 6 「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行(国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イスラム開発銀行、予防接種のための国際金融フアンシテイ及び欧州評議会開発銀行を含む。)向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

【i～p 同左】

【(第十三面)～(第二十四面) 同左】

(別紙様式第六号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要				
国際株式 の該当番 号	イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本
	当四半 期末	前四半 期末	当四半 期末	前四半 期末

[略]				
4	カウンターパーティー信用リスク			
5	うち、 <u>SARCCR</u> 適用分			
[項を削る。]				
[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、連結自己資本規制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・b 略]

○ 項番2「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第十四条に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合計額に8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面において同じ。）（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[d～j 略]

k 項番5「カウンターパーティー信用リスクのうち、SARCCR適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率告示第三十四条第五項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）並びにこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[同左]				
4	カウンターパーティー信用リスク			
5-1	うち、 <u>カレント・エクスポート</u> 方式適用分			
5-2	うち、標準方式適用分			
[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、連結自己資本規制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・b 同左]

○ 項番2「信用リスクのうち、標準的手法適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第十四条第一項に規定する信用リスク・アセットの額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（リスクの種類に応じ、リスク・アセットの額の合計額に8パーセントを乗じて得た額又はリスク相当額の合計額をいう。以下この面において同じ。）（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[d～j 同左]

k 項番5-1「カウンターパーティー信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七条（連結自己資本規制比率告示第三十四条第五項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）並びにこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

<p>「1」 銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当かどうかを判断するための基準等の一部を改正する件（平成三十年金融庁告示第十三号）附則第十条第一項の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いる場合には、項番5と項番6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、カレント・エクスポージャー方式により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。</p> <p>[m~pp 略]</p>	<p>「1」 項番5-2「カウンターパーティー信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八条（連結自己資本規制比率告示第三百二十四条第五項及び第四百二十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定により算出した額に派生商品取引及び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）及びこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。</p> <p>[m~pp 同左]</p>
<p>備考 表中の「1」の記載及び対象規定の二重傍線を付した部分を除く全体に付した傍線は注記である。</p>	<p>【(第二面)～(第四面) 略】</p> <p>【(第二面)～(第四面) 同左】</p>