

(単位：百万円、%)

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
小計				
合計				

(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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

- a 「国又は地域」の欄には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである国又は地域のうち、信用リスク・アセットを有し、かつ対象期間中に国又は地域の金融当局が定める比率（本邦の場合には自己資本比率告示第二条の二第四項第一号又は第十四条の二第四項第一号に規定する別に指定した比率をいい、本邦以外の国又は地域の場合には自己資本比率告示第二条の二第四項第二号又は第十四条の二第四項第二号に規定する本邦以外の国又は地域の金融当局が定める比率をいう。以下この面において「各金融当局が定める比率」という。）が零を超えた国又は地域をそれぞれ記載すること。
- b イ欄には、「国又は地域」の欄に関して、開示の基準日時点で適用される各金融当局が定める比率をそれぞれ記載すること。
- c ロ欄には、カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いるため、国又は地域別に算出された信用リスク・アセットの額をそれぞれ記載すること。この場合において、当該算出に用いた地理的配分の方法を開示するとともに、最終リスクベースでの算出を行っていない国又は地域及び信用リスク・アセットの種類について、説明を付すこと。また、信用リスク・アセットの額の主な変動要因及び適用される各金融当局が定める比率との関係性に関して、簡潔に情報を提供すること。
- d 「小計」の項には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである国又は地域のうち、各金融当局が定める比率が零を超える国又は地域に係る信用リスク・アセットの合計額を記載すること。
- e 「合計」の項には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである全ての国又は地域（各金融当局が定める比率が設定されていない国又は地域及び各金融当局が定める比率を零と設定している国又は地域を含む。）に係る信用リスク・アセットの合計額（ロ欄）、自金融機関のカウンター・シクリカル・バッファー比率（ハ欄）及びカウンター・シクリカル・バッファーの所要水準を満たすために保有する

普通株式等 Tier1 資本の額（ニ欄）をそれぞれ記載すること。

- f 「合計」の項ハ欄の比率は、当期に係る別紙様式第八号又は別紙様式第九号の開示を行う場合、これらの様式の項番9「カウンター・シクリカル・バッファー比率」の項イ欄の比率と一致する。
- g この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。
- h この面に記載する比率は、小数点以下二位未満の端数があるときは、これを切り捨てること。

(単位：百万円)

GSIB 1 :G-SIB 選定指標				
国際様式 の該当番 号			当期末	前期末
1	国際的な活動	対外与信の残高		
2		対外債務の残高		
3	規模	資産及び取引に関する残高の合計額		
4	相互関連性	金融機関等向け与信に関する残高の合計額		
5		金融機関等に対する債務に関する残高の合計額		
6		発行済の有価証券の残高		
7	代替可能性/ 金融インフラ	信託財産及びこれに類する資産の残高		
8		決済システムを通じた決済の年間の合計額		
9		債券及び株式に係る引受けの年間の合計額		
10	複雑性	金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る想定元本額の合計額		
11		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		
12		売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額		

(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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a 国際様式の該当番号（以下この面において「項番」という。）3「規模 資産及び取引に関する残高の合計額」の項には、次に掲げる額の合計額を記載すること。

(1) オン・バランス資産の額（貸借対照表又は連結貸借対照表の総資産の額から支払承諾見返勘定の額並びに(2)及び(3)に掲げる事項に関して貸借対照表又は連結貸借対照表に計上されている額を控除した額をいう。）

(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(2)及び(4)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。b及びcにおいて同じ。）で計算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) レポ形式の取引に関する額(レポ形式の取引における現金の受取債権の額及びレポ形式の取引の単位ごとに算出した取引の相手方に対するエクスポージャーの額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。))の合計額をいう。)

(4) オフ・バランス取引(デリバティブ取引等及びレポ形式の取引を除く。)に関する額(取引の相手方に対する信用リスクに係るエクスポージャーの額、対象資産に係るエクスポージャーの額及び証券化エクスポージャーの額の合計額をいう。)

b 項番4「相互関連性 金融機関等向け与信に関する残高の合計額」の項には、金融機関等(金融商品取引法第二条第九項に規定する金融商品取引業者、保険会社、中央清算機関、年金基金その他これらに類する事業を営む者を含む。以下b及びcにおいて同じ。)向け与信に関する次に掲げる事項の残高の合計額を記載すること。

(1) 金融機関等向け預金及び貸出金の額(コミットメントの未引出額を含む。)

(2) 金融機関等が発行した有価証券(担保付社債、一般無担保社債、劣後債、短期社債、譲渡性預金及び株式をいう。項番6において同じ。)の保有額

(3) 金融機関等とのレポ形式の取引のカレント・エクスポージャーの額(法的に有効な相対ネットティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を下回らないものに限る。)

(4) 金融商品取引法第二条第十四項に規定する金融商品市場及び同条第八項第三号ロに規定する外国金融商品市場(項番10及びcにおいて「金融商品市場等」という。)によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る公正価値評価額及びカレント・エクスポージャー方式で計算したアドオンの額(法的に有効な相対ネットティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を下回らないものに限る。)

c 項番5「相互関連性 金融機関等に対する債務に関する残高の合計額」の項には、次に掲げる事項の残高の合計額を記載すること。

(1) 金融機関等からの預金及び借入金金の額(コミットメントの未引出額を含む。)

(2) 金融機関等とのレポ形式の取引のカレント・エクスポージャーの額(法的に有効な相対ネットティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を上回らないものに限る。)

(3) 金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る公正価値評価額及びカレント・エクスポージャー方式で計算したアドオンの額(法的に有効な相対ネットティング契約の効果を勘案することができるものとし、零を上回らないものに限る。)

d 項番8「代替可能性/金融インフラ 決済システムを通じた決済の年間の合計額」の項には、直近に終了した事業年度における日本銀行金融ネットワークシステム、全国銀行資金決済ネットワークその他これらに類する決済システムを通じた決済の年間の合計額を記載すること。

e 項番9「代替可能性/金融インフラ 債券及び株式に係る引受けの年間の合計額」の項には、直近に終了した事業年度における債券及び株式に係る引受け(金融商品取引法第二条第八項第六号に規定する有価証券の引受けをいう。)の年間の合計額を記載すること。

- f 項番10「複雑性 金融商品市場等によらないで行う金融機関等との派生商品取引及び長期決済期間取引に係る想定元本額の合計額」における金融機関等とは、bに規定する金融機関等をいう。
- g 項番12「複雑性 売買目的有価証券及びその他有価証券の残高の合計額」の項には、売買目的有価証券及びその他有価証券（いずれも流動性が高いと認められるものを除く。）の残高の合計額を記載すること。
- h この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額がない場合には項を削除せず、「－」を記載すること。
- i この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。
- j この面は、項番3の額を直近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場合に限り、作成するものとする。

(単位：百万円、%)

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファ比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
小計				
合計				

(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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

- a 「国又は地域」の欄には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである国又は地域のうち、信用リスク・アセットを有し、かつ対象期間中に国又は地域の金融当局が定める比率（本邦の場合には自己資本比率告示第二条の二第四項第一号又は第十四条の二第四項第一号に規定する別に指定した比率をいい、本邦以外の国又は地域の場合には自己資本比率告示第二条の二第四項第二号又は第十四条の二第四項第二号に規定する本邦以外の国又は地域の金融当局が定める比率をいう。以下この面において「各金融当局が定める比率」という。）が零を超えた国又は地域をそれぞれ記載すること。
- b イ欄には、「国又は地域」の欄に関して、開示の基準日時点で適用される各金融当局が定める比率をそれぞれ記載すること。
- c ロ欄には、カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いるため、国又は地域別に算出された信用リスク・アセットの額をそれぞれ記載すること。この場合において、当該算出に用いた地理的配分の方法を開示するとともに、最終リスクベースでの算出を行っていない国又は地域及び信用リスク・アセットの種類について、説明を付すこと。また、信用リスク・アセットの額の主な変動要因及び適用される各金融当局が定める比率との関係性に関して、簡潔に情報を提供すること。
- d 「小計」の項には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである国又は地域のうち、各金融当局が定める比率が零を超える国又は地域に係る信用リスク・アセットの合計額を記載すること。
- e 「合計」の項には、バーゼル銀行監督委員会のメンバーである全ての国又は地域（各金融当局が定める比率が設定されていない国又は地域及び各金融当局が定める比率を零と設定している国又は地域を含む。）に係る信用リスク・アセットの合計額（ロ欄）、自金融機関のカウンター・シクリカル・バッファ比率（ハ欄）及びカウンター・シクリカル・バッファの所要水準を満たすために保有する

普通株式等 Tier1 資本の額（ニ欄）をそれぞれ記載すること。

- f 「合計」の項ハ欄の比率は、当中間期に係る別紙様式第八号又は別紙様式第九号の開示を行う場合、これらの様式の項番9「カウンター・シクリカル・バッファー比率」の項イ欄の比率と一致する。
- g この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。
- h この面に記載する比率は、小数点以下二位未満の端数があるときは、これを切り捨てること。