

○ 銀行法施行規則第十九条の二第一項第五号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項（平成二十六年金融庁告示第七号）

次の表により、改正前欄に掲げる規定の傍線を付した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た部分のように改め、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、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、改正後欄に掲げる対象規定で改正前欄にこれに対応するものを掲げていないものは、これを加える。

（注）平成三十年六月八日、同年六月十八日及び十月十二日公表の改正案適用後のもの。

改正後	改正前（注）
<p>（単体自己資本比率を算出する銀行における事業年度の開示事項）</p> <p>第二条 「略」</p> <p>2 「略」</p> <p>3 第一項の定性的な開示事項は、次に掲げる事項（連結自己資本比率を算出する銀行にあつては、第十号及び第十一号に掲げる事項に限る。）</p> <p>「一〇五 略」</p> <p>六 証券化取引に係るリスクに関する次に掲げる事項</p> <p>イ 「略」</p> <p>ロ 自己資本比率告示第二百四十八条第一項第一号から第四号まで（自己資本比率告示第二百二条の二第二項に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</p>	<p>（単体自己資本比率を算出する銀行における事業年度の開示事項）</p> <p>第二条 「同上」</p> <p>2 「同上」</p> <p>3 「同上」</p> <p>「一〇五 同上」</p> <p>六 「同上」</p> <p>イ 「同上」</p> <p>ロ 自己資本比率告示第二百四十九条第四項第三号から第六号まで（自己資本比率告示第二百五十四条第二項及び第三百二条の四第一項において準用する場合を含む。）に規定する体制の整備</p>

「ハ」ト 略]

「七」十二 略]

「4」8 略]

(銀行持株会社における連結会計年度の開示事項)

第七条 「略」]

2 「略」]

3 第二項の定性的な開示事項は、次に掲げる事項とする。

一 「略」]

二 前号に掲げる事項のほか、第一項の定性的な開示事項については、第二条第三項の規定を準用する。この場合において、同項中「第一項の」とあるのは「第七条第一項の」と、「次に掲げる事項(連結自己資本比率を算出する銀行にあつては、第十号及び第十一号に掲げる事項に限る。)」とあるのは「次に掲げる事項」と、同項第二号中「銀行全体」とあるのは「持株会社グループ(持株自己資本比率告示第三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をいう。第六号ハにおいて同じ。)」と、同項第三号ニ(1)中「信用リスク・アセットの額(自己資本比率告示第十五条の特別目的会社等を有する銀行にあつては、当該特別目的会社等を含む連結の範囲における信用リスク・アセットの額)」とあるのは「信用リスク・アセットの額」と、同項第六号ロ中「自己資本比率告示第二百四十八条第一項第一号か

備及びその運用状況の概要

「ハ」ト 同上]

「七」十二 同上]

「4」8 同上]

(銀行持株会社における連結会計年度の開示事項)

第七条 「同上」]

2 「同上」]

3 「同上」]

一 「同上」]

二 前号に掲げる事項のほか、第一項の定性的な開示事項については、第二条第三項の規定を準用する。この場合において、同項中「第一項の」とあるのは「第七条第一項の」と、「次に掲げる事項(連結自己資本比率を算出する銀行にあつては、第十号及び第十一号に掲げる事項に限る。)」とあるのは「次に掲げる事項」と、同項第二号中「銀行全体」とあるのは「持株会社グループ(持株自己資本比率告示第三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をいう。第六号ハにおいて同じ。)」と、同項第三号ニ(1)中「信用リスク・アセットの額(自己資本比率告示第十五条の特別目的会社等を有する銀行にあつては、当該特別目的会社等を含む連結の範囲における信用リスク・アセットの額)」とあるのは「信用リスク・アセットの額」と、同項第六号ロ中「自己資本比率告示第二百四十九条第四項第三号か

ら第四号まで（自己資本比率告示第二百二条の二第二項」とあるのは「持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第一号から第四号まで（持株自己資本比率告示第二百八十条の二第二項」と、同号ハ中「保有しているかどうかの別」とあるのは「保有しているかどうかの別並びに持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（当該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、かつ、当該持株会社グループがその経営に参与し又は助言を提供しているものの名称」と、同項第七号中「自己資本比率告示第十四条各号」とあるのは「持株自己資本比率告示第二条各号」と、同項第十一号及び第十二号中「貸借対照表」とあるのは「連結貸借対照表」と、同項第十一号中「別紙様式第一号」とあるのは「別紙様式第五号」と読み替えるものとする。

〔4～6 略〕

第十条 「略」
（単体自己資本比率を算出する銀行における事業年度の開示事項）

2 「略」

3 第一項の定性的な開示事項は、次に掲げる事項とする。

〔一～五 略〕

六 証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項

ら第六号まで（自己資本比率告示第二百五十四条第二項及び第三百二条の四第一項において」とあるのは「持株自己資本比率告示第二百二十七条第四項第三号から第六号まで（持株自己資本比率告示第二百三十二条第二項及び第二百八十条の四第一項において」と、同号ハ中「保有しているかどうかの別」とあるのは「保有しているかどうかの別並びに持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（当該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、かつ、当該持株会社グループがその経営に参与し又は助言を提供しているものの名称」と、同項第七号中「自己資本比率告示第十四条各号」とあるのは「持株自己資本比率告示第二条各号」と、同項第十一号及び第十二号中「貸借対照表」とあるのは「連結貸借対照表」と、同項第十一号中「別紙様式第一号」とあるのは「別紙様式第五号」と読み替えるものとする。

〔4～6 同上〕

第十条 「同上」
（単体自己資本比率を算出する銀行における事業年度の開示事項）

2 「同上」

3 「同上」

〔一～五 同上〕

六 「同上」

イ 「略」

ロ 自己資本比率告示第二百四十八条第一項第一号から第四号まで（自己資本比率告示第二百二条の二第二項に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

「ハルル 略」

「七く十 略」

4 第一項の定量的な開示事項は、次に掲げる事項とする。

一 「略」

二 信用リスク（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。）に関する次に掲げる事項

「イホ 略」

へ 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一パーセント未満である場合には、区分を要しない。

）並びに自己資本比率告示第七十九条の五第二項第二号、第七十七条の二第二項第二号、第二百四十八条（自己資本比率告示第二百二十五条及び第二百二十七条において準用する場合に限る。）並びに第二百四十八条の四第一項第一号及び第二号（自己資本比率告示第二百二十五条及び第二百二十七条において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十パーセントのリスク・

イ 「同上」

ロ 自己資本比率告示第二百四十九条第四項第三号から第六号まで（自己資本比率告示第二百五十四条第二項及び第三百二条の四第一項に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

「ハルル 同上」

「七く十 同上」

4 「同上」

一 「同上」

二 「同上」

「イホ 同上」

へ 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一パーセント未満である場合には、区分を要しない。

）並びに自己資本比率告示第七十九条の五第二項第二号、第七十七条の二第二項第二号及び第二百四十七条第一項（自己資本比率告示第二百二十五条、第二百二十七条及び第三百三十六条第一項において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十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

ウェイトが適用されるエクスポージャーの額

〔ト〕ヌ 略〕

〔三・四 略〕

五 証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項

イ 銀行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)〕(8) 略〕

(9) 自己資本比率告示第二百四十八条並びに第二百四十八条の

四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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)〕(11) 略〕

ロ 銀行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)〕(2) 略〕

(3) 自己資本比率告示第二百四十八条並びに第二百四十八条の

四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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) 〔略〕

ハ 銀行がオリジネーター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

〔ト〕ヌ 同上〕

〔三・四 同上〕

五 〔同上〕

イ 〔同上〕

〔(1)〕(8) 同上〕

(9) 自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定により千二百五十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)〕(11) 同上〕

ロ 〔同上〕

〔(1)〕(2) 同上〕

(3) 自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定により千二百五十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) 〔同上〕

ハ 〔同上〕

に掲げる事項

〔(1)～(8) 略〕

(9) 自己資本比率告示第三百二条の二第二項の規定において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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) 〔略〕

ニ 銀行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)～(3) 略〕

(4) 自己資本比率告示第三百二条の二第二項の規定において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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

〔六〇九 略〕

5 〔略〕

(連結自己資本比率を算出する銀行における連結会計年度の開示事項)

第十二条 〔略〕

〔(1)～(8) 同上〕

(9) 自己資本比率告示第三百二条の五第二項において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十七条(第一項第二号を除く。)の規定により百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) 〔同上〕

ニ 〔同上〕

〔(1)～(3) 同上〕

(4) 自己資本比率告示第三百二条の五第二項において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十七条(第一項第二号を除く。)の規定により百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

〔六〇九 同上〕

5 〔同上〕

(連結自己資本比率を算出する銀行における連結会計年度の開示事項)

第十二条 〔同上〕

2	〔略〕
3	第一項の定性的な開示事項は、次に掲げる事項とする。
〔一〕	六 略
七	証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項
イ	〔略〕
ロ	自己資本比率告示第二百四十八条第一項第一号から第四号まで（自己資本比率告示第三百二条の二第二項に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
〔ハ〕	略
〔八〕	十一 略
4	第一項の定量的な開示事項は、次に掲げる事項とする。
〔一〕	二 略
三	信用リスク（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。）に関する次に掲げる事項
〔イ〕	ホ 略
<ul style="list-style-type: none"> へ 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一パーセント未満である場合には、区分を要しない。 	<ul style="list-style-type: none"> （）並びに自己資本比率告示第七十九条の五第二項第二号、第七十七条の二第二項第二号、第二百四十八条（自己資本比率告示

2	〔同上〕
3	〔同上〕
〔一〕	六 同上
七	〔同上〕
イ	〔同上〕
ロ	自己資本比率告示第二百四十九条第四項第三号から第六号まで（自己資本比率告示第二百五十四条第二項及び第三百二条の四第一項に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
〔ハ〕	略 同上
〔八〕	十一 同上
4	〔同上〕
〔一〕	二 同上
三	〔同上〕
〔イ〕	ホ 同上
<ul style="list-style-type: none"> へ 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一パーセント未満である場合には、区分を要しない。 	<ul style="list-style-type: none"> （）並びに自己資本比率告示第七十九条の五第二項第二号、第七十七条の二第二項第二号及び第二百四十七条第一項（自己資本

示第百二十五条及び第百二十七条において準用する場合に限る。
。並びに第百四十八条の四第一項第一号及び第二号（自己資本比率告示第百二十五条及び第百二十七条において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十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

〔ト〕又 略〕

〔四・五 略〕

六 証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項

イ 連結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〕(8) 略〕

(9) 自己資本比率告示第百四十八条並びに第百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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〕(11) 略〕

ロ 連結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〕(2) 略〕

(3) 自己資本比率告示第百四十八条並びに第百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十パーセン

本比率告示第百二十五条、第百二十七条及び第百三十六条第一項において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十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

〔ト〕又 同上〕

〔四・五 同上〕

六 〔同上〕

イ 〔同上〕

〔1〕(8) 同上〕

(9) 自己資本比率告示第百四十七条第一項の規定により千二百五十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〕(11) 同上〕

ロ 〔同上〕

〔1〕(2) 同上〕

(3) 自己資本比率告示第百四十七条第一項の規定により千二百五十パーセントのリスク・ウェイトが適用される証券化エ

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) 「略」

ハ 連結グループがオリジネーター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)～(8) 略〕

(9) 自己資本比率告示第三百二条の二第二項の規定において読み替えて準用する第二百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により二百五十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) 「略」

ニ 連結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)～(3) 略〕

(4) 自己資本比率告示第三百二条の二第二項の規定において読み替えて準用する第二百四十八条の四第一項第一号及び第二号の規定により二百五十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

〔七～十 略〕

クスポートージャーの額及び主な原資産の種類別の内訳

(4) 「同上」

ハ 「同上」

〔(1)～(8) 同上〕

(9) 自己資本比率告示第三百二条の五第二項において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十七条（第一項第二号を除く。）の規定により百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) 「同上」

ニ 「同上」

〔(1)～(3) 同上〕

(4) 自己資本比率告示第三百二条の五第二項において読み替えて準用する自己資本比率告示第二百四十七条（第一項第二号を除く。）の規定により百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

〔七～十 同上〕

5 「略」	(銀行持株会社における連結会計年度の開示事項)	5 「同上」	(銀行持株会社における連結会計年度の開示事項)
第十五条 「略」	第十五条 「同上」	2 「略」	2 「同上」
3 第一項の定性的な開示事項は、次に掲げる事項とする。	3 「同上」	「一〇六 略」	「一〇六 同上」
七 証券化エクスポージャーに関する次に掲げる事項	七 「同上」	イ 「略」	イ 「同上」
ロ 持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第一号から第四号まで(持株自己資本比率告示第二百八十条の二第二項に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	ロ 持株自己資本比率告示第二百二十七条第四項第三号から第六号まで(持株自己資本比率告示第二百三十二条第二項及び第二百八十条の四第一項に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	「ハ〇ル 略」	「ハ〇ル 同上」
「八〇十一 略」	「八〇十一 同上」	4 第一項の定量的な開示事項は、次に掲げる事項とする。	4 「同上」
「一・二 略」	「一・二 同上」	三 信用リスク(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。)に関する次に掲げる事項	三 「同上」
「イ〇ホ 略」	「イ〇ホ 同上」	へ 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	へ 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一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五十七条の五第二項第二号、
第百五十五条の二第二項第二号、
第百二十六条（持株自己資本比率告示第百三条及び第百五条において準用する場合に限る。）並びに第百二十六条の四第一項第一号及び第二号（持株自己資本比率告示第百三条及び第百五条において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十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

〔ト〕又 略〕

〔四・五 略〕

六 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)〕(8) 略〕

(9) 持株自己資本比率告示第百二十六条並びに第百二十六条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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)〕(11) 略〕

ロ 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

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一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五十七条の五第二項第二号、
第百五十五条の二第二項第二号、
第百二十五条第一項（持株自己資本比率告示第百三条、第百五条及び第百十四条第一項において準用する場合に限る。）の規定により千二百五十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

〔ト〕又 同上〕

〔四・五 同上〕

六 〔同上〕

イ 〔同上〕

〔(1)〕(8) 同上〕

(9) 持株自己資本比率告示第百二十五条第一項の規定により千二百五十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)〕(11) 同上〕

ロ 〔同上〕

に掲げる事項

〔(1)・(2) 略〕

(3) 持株自己資本比率告示第二百二十六条並びに第二百二十六条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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) 〔略〕

ハ 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)～(8) 略〕

(9) 持株自己資本比率告示第二百八十条の二第二項の規定において読み替えて準用する第二百二十六条の四第一項第一号及び第二号の規定により千二百五十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) 〔略〕

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)～(3) 略〕

(4) 持株自己資本比率告示第二百八十条の二第二項の規定において読み替えて準用する第二百二十六条の四第一項第一号及

〔(1)・(2) 同上〕

(3) 持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により千二百五十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) 〔同上〕

ハ 〔同上〕

〔(1)～(8) 同上〕

(9) 持株自己資本比率告示第二百八十条の五第二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二百二十五条(第一項第二号を除く。)の規定により百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) 〔同上〕

ニ 〔同上〕

〔(1)～(3) 同上〕

(4) 持株自己資本比率告示第二百八十条の五第二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二百二十五条(第

び第二号の規定により千二百五十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

〔七〇十 略〕

5
〔略〕

一項第二号を除く。）の規定により百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

〔七〇十 同上〕

5
〔同上〕

(別紙様式第二号)

(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	【略】
		リスク・アセット		
		当期末	前期末	
【略】				
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポートジャー			
13	うち、 <u>内部格付手法</u> 適用方式又は内部評価方式適用分			
14	うち、 <u>外部格付手法</u> 適用方式適用分			
15	うち、 <u>標準的手法</u> 適用方式適用分			
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分			
【略】				

(別紙様式第二号)

(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	【同左】
		リスク・アセット		
		当期末	前期末	
【同左】				
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポートジャー			
13	うち、 <u>内部格付手法</u> における外部格付適用方式又は内部評価方式適用分			
14	うち、 <u>内部格付手法</u> における指定関連方式適用分			
15	うち、 <u>標準的手法</u> 適用方式適用分			
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分			
【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、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~aa 略]

bb 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

dd 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付準拠方式適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付準拠方式適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「外部格付準拠方式が適用される証券化エ

(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~aa 同左]

bb 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

dd 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「内部格付手法における

クスボージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載すること
を要しない。

ff 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法進捗方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

gg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスボージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスボージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「1250%のリスク・ウェイトが適用さ

指定関数方式が適用される証券化エクスボージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

ff 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、標準的手法適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

gg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、標準的手法適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法が適用される証券化エクスボージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスボージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスボージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額は、当期に係る第二十四面及び第二十五面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の

れる証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

㉔ 項番13から項番15までの項のロ欄及びニ欄の「前期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、項番15と「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウエイト適用分」の項との間に「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」、「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」及び「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」との名称の項（項番を付さないこと。）を追加すること。この場合においては、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等の一部を改正する件（平成三十一年金融庁告示第 号）第●条の規定による改正後の銀行法施行規則第十九条の二第一項第五号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項の規定にかかわらず、追加するこれらの項のロ欄及びニ欄の「前期末」の記載は、なお従前の例によること（なお、イ欄及びハ欄は記載することはない。）。

㉕ [略]

㉖ [略]

㉗ [略]

㉘ [略]

規定又は特株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

[加える。]

㉔ [同左]

㉕ [同左]

㉖ [同左]

㉗ [同左]

〇〇 [略]
㊦ [略]
㊧ [略]
㊨ [略]
㊩ [略]
㊪ [略]
㊫ [略]

〔(第二面)～(第二十一面) 略〕

(第二十二面)

〔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、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 [略]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

㊬ [同左]
㊭ [同左]
㊮ [同左]
㊯ [同左]
㊰ [同左]
㊱ [同左]
㊲ [同左]

〔(第二面)～(第二十一面) 同左〕

(第二十二面)

〔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 [同左]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

- 。 ロ欄には、自金融機関がオリジネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないとを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。
- d 三欄には、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないとを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。
- e ホ欄には、自金融機関がスポンサーとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号

- 。 ロ欄には、自金融機関がオリジネーターとして関与している、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下この面において同じ。）の効果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。
- d 三欄からへ欄までには、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。
- e ホ欄には、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（信用リスク削減手法の効果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない

又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 略]

h ロ欄又はホ欄には、合成型証券化取引における、信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下このhにおいて同じ。）の効果を勘案した後のエクスポージャーの額を記載すること。また、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合で、当該プロテクションを売却したときには、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i~1 略]

(第二十三面)

【表略】

a [略]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率

場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 同左]

h 合成型証券化取引において、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合、当該プロテクションの効果を勘案した後のエクスポージャーの額はロ欄又はホ欄に計上すること。また、自金融機関が当該プロテクションを売却した場合、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i~1 同左]

(第二十三面)

【同左】

a [同左]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二十六条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないとを含む。)には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

- ロ欄には、自金融機関がオ리지ネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないとを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

- d 三欄には、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないとを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

- e ホ欄には、自金融機関がスポンサーとして関与している合成型証券化取引に係る証券化

- ロ欄には、自金融機関がオ리지ネーターとして関与している、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下この面において同じ。）の効果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

- d 三欄からへ欄までには、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。

- e ホ欄には、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（信用リスク削減手法の効

エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 略]

h ロ欄又はホ欄には、合成型証券化取引における、信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下このhにおいて同じ。）の効果を勘案した後のエクスポージャーの額を記載すること。また、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合で、当該プロテクションを売却したときには、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i～] 略]

果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 同左]

h 合成型証券化取引において、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合、当該プロテクションの効果を勘案した後のエクスポージャーの額をロ欄又はホ欄に計上すること。また、自金融機関が当該プロテクションを売却した場合、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i～] 同左]

(第二十四面)

(単位：百万円)

SBC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）		[略]	
項番		イ]
		合計	
[略]			
エクスポージャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は <u>内部評価方式</u> が適用される証券化エクスポージャー		
7	外部格付 <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー		
8	<u>標準的手法</u> <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー		
9	<u>1250%</u> 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		
信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は <u>内部評価方式</u> により算出した信用リスク・アセット		
11	外部格付 <u>準備方式</u> により算出した信用リスク・アセット		

(第二十四面)

(単位：百万円)

SBC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）		[同左]	
項番		イ	左]
		合計	
[同左]			
エクスポージャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は <u>内部評価方式</u> が適用される証券化エクスポージャー		
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー		
8	<u>標準的手法</u> が適用される証券化エクスポージャー		
9	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項の規定により <u>1250%</u> 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		
信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は <u>内部評価方式</u> により算出した信用リスク・アセット		
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット		

12	標準的手法 <u>準備方式</u> により算出した信用リスク・アセット	
13	<u>1250%</u> のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法準備方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
15	<u>外部格付準備方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
16	<u>標準的手法準備方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
17	<u>1250%</u> のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	

(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～c 略]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に並び、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率告示第二百

12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	
13	自己資本比率告示 <u>第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示<u>第二百五条第一項の規定</u>により<u>1250%</u>のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット</u>	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法における外部格付準備方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
15	<u>内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
16	<u>標準的手法が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
17	自己資本比率告示 <u>第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示<u>第二百五条第一項の規定</u>により<u>1250%</u>のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本</u>	

(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～c 同左]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に並び、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率告示第二百

六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限及び自己資本比率告示第二百四十八條の二第一項又は持株自己資本比率告示第二百二十六條の二第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

Ⓕ 項番9 「1250%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」、項番13 「1250%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に係る信用リスク・アセット」及び項番17 「1250%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に係る所要自己資本」の項には、そのリスク・ウェイトの算出方式につき内部格付準拠方式、外部格付準拠方式、内部評価手法又は標準的準拠方式のいずれも用いることなく1250%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に係る計数を記載すること。

Ⓖ 項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。)
又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。)
に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。))又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。))に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限及び自己資本比率告示第二百五十五條第一項又は持株自己資本比率告示第二百三十三條第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

【加える。】

Ⓕ 項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の

⌚ 項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付準拠方式適用分の項イ欄の額と一致する。

⌛ 項番12「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番12「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法準拠方式適用分の項イ欄の額と一致する。

⌜ 項番13「1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番13「1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウエイト適用分の項イ欄の額と一致する。

⌝ 項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エ

項イ欄の額と一致する。

⌞ 項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分の項イ欄の額と一致する。

⌟ 項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分の項イ欄の額と一致する。

⌠ 項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十五面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウエイト適用分の項イ欄の額と一致する。

⌡ 項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセット」の

クスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊦ 項番15「外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番15「外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付準拠方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊧ 項番16「標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番16「標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法準拠方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊨ 項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊩ [略]
㊪ [略]

額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊦ 項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊧ 項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊨ 項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十五面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額と一致する。

㊩ [同左]
㊪ [同左]

(第二十五面)

(単位：百万円)

SBC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポーチャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）		イ		【略】
項番		合計		【略】
		【略】		
	エクスポーチャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法 <u>進捗方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポーチャー			
7	外部格付 <u>進捗方式</u> が適用される証券化エクスポーチャー			
8	<u>標準的手法進捗方式</u> が適用される証券化エクスポーチャー			
9	<u>1250%のリスク・ウェイト</u> が適用される証券化エクスポーチャー			
	信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法 <u>進捗方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			

(第二十五面)

(単位：百万円)

SBC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポーチャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）		イ		【同左】
項番		合計		【同左】
		【同左】		
	エクスポーチャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法における外部格付 <u>進捗方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポーチャー			
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポーチャー			
8	<u>標準的手法</u> が適用される証券化エクスポーチャー			
9	自己資本比率告示第二百四十七条 <u>第一項の規定</u> 又は <u>持株自己資本比率告示第二十五条第一項の規定</u> により <u>1250%のリスク・ウェイト</u> が適用される証券化エクスポーチャー			
	信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法における外部格付 <u>進捗方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			

11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	
13	1250%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に係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
17	1250%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に係る所要自己資本	

(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。

11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	
13	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五十一条の規定により1250%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に係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
17	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五十一条の規定により1250%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に係る所要自己資本	

(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～c 略]

d 「信用リスク・アセットの額（算出方法別）」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の信用リスク・アセットの額（自己資本比率告示第二百六十七条又は持株自己資本比率告示第二百四十五条に規定するリスク・ウェイトに関する上限を適用する前の額）を記載すること。

e 「所要自己資本の額（算出方法別）」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額（自己資本比率告示第二百六十七条又は持株自己資本比率告示第二百四十五条に規定するリスク・ウェイトに関する上限及び自己資本比率告示第二百四十八条の二第一項又は持株自己資本比率告示第二百二十六条の二第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額）を記載すること。

f 項番9 「1250%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」、項番13 「1250%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に係る信用リスク・アセット」及び項番17 「1250%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に係る所要自己資本」の項には、そのリスク・ウェイトの算出方式につき内部格付準拠方式、外部格付準拠方式、内部評価手法又は標準的手法準拠方式のいずれも用いることなく1250%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に係る計数を記載すること。

g 項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により

[a～c 同左]

d 「信用リスク・アセットの額（算出方法別）」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の信用リスク・アセットの額（自己資本比率告示第二百五十二条第一項（自己資本比率告示第二百七十条第一項において準用する場合を含む。）又は持株自己資本比率告示第二百三十条第一項（持株自己資本比率告示第二百四十八条第一項において準用する場合を含む。）に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限を適用する前の額）を記載すること。

e 「所要自己資本の額（算出方法別）」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額（自己資本比率告示第二百五十二条第一項（自己資本比率告示第二百七十条第一項において準用する場合を含む。）又は持株自己資本比率告示第二百三十条第一項（持株自己資本比率告示第二百四十八条第一項において準用する場合を含む。）に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限及び自己資本比率告示第二百五十五条第一項又は持株自己資本比率告示第二百三十三条第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額）を記載すること。

[加える。]

f 項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番10 「内部格付手法における外部格

算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法適用方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番11「外部格付適用方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番11「外部格付適用方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、外部格付適用方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番12「標準的手法適用方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番12「標準的手法適用方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法適用方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番13「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番13「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番14「内部格付手法適用方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャー

付適用方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法における外部格付適用方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十四面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセット」の額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌋ 項番14「内部格付手法における外部格付適用方式又は内部評価方式が適用される証券化

に係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番14「内部格付手法」又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法」又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額と一致する。

Ⓛ 項番15「外部格付」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番15「外部格付」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付」が適用される項ハ欄の額と一致する。

Ⓜ 項番16「標準的手法」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番16「標準的手法」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法」が適用される項ハ欄の額と一致する。

Ⓨ 項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額と一致する。

エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番14「内部格付」手法における外部格付」又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付」が適用される項ハ欄の額と一致する。

Ⓛ 項番15「内部格付」における指定関数」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番15「内部格付」における指定関数」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付」における指定関数」が適用される項ハ欄の額と一致する。

Ⓜ 項番16「標準的手法」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番16「標準的手法」が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法」が適用される項ハ欄の額と一致する。

Ⓨ 項番17「自己資本比率」第二四十七条第一項の規定又は特殊自己資本比率」第二四十七条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十四面の項番17「自己資本比率」第二四十七条第一項の規定又は特殊自己資本比率」第二四十七条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額と一致す

○ [略]
 □ [略]
 ≡ [略]

【(第二十六面)～(第三十二面) 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					
国際様式の該当番号	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポージャー	イ		ロ	
		リスク・アセット		[略]	
		当中間期末	前中間期末		
[略]					
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポージャー				
13	うち、内部格付手法連拠方式又は内部評価方式適用分				
	うち、外部格付連拠方式適用分				
14	うち、 <u>標準的手法連拠方式適用分</u>				
15	うち、 <u>標準的手法連拠方式適用分</u>				

る。

□ [同左]
 ≡ [同左]
 ○ [同左]

【(第二十六面)～(第三十二面) 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	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポージャー	イ		ロ	
		リスク・アセット		[同左]	
		当中間期末	前中間期末		
[同左]					
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつている証券化エクスポージャー				
13	うち、内部格付手法における外部格付連拠方式又は内部評価方式適用分				
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分				
14	うち、 <u>標準的手法連拠方式適用分</u>				
15	うち、 <u>標準的手法連拠方式適用分</u>				

	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分			
[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特殊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~aa 略]

bb 項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及びニ欄の「前中間期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄に記載することを要しない。

dd 項番14 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付準拠方式適用分」の項イ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分			
[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、自己資本比率告示及び特殊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~aa 同左]

bb 項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

dd 項番14 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付進捗方式適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「外部格付進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前中間期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

ef 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法進捗方式により算出した信用リスク・アセット」の項へ欄の合計額と一致する。

eg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前中間期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「1250%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に係る信用リスク・アセット」の項へ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。

ef 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項へ欄の合計額と一致する。

eg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項の規定により1250%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に係る信用リスク・アセット」の項へ欄の合計額と一致する。

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。

ii 項番13から項番15までの項のロ欄及び三欄の「前中間期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、項番15と「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項との間に「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」、「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」及び「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」との名称の項（項番を付さないこと。）を追加すること。この場合においては、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等の一部を改正する件（平成三十一年金融庁告示第 号）第●条の規定による改正後の銀行法施行規則第十九条の二第一項第五号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項の規定にかかわらず、追加すること（なお、イの項のロ欄及び三欄の「前中間期末」の記載は、なお従前の例によること（なお、イ欄及びハ欄は記載することは要しない。））。

kk [略]

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項へ欄の額は、当中間期に係る第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は特株自己資本比率告示第二百五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項へ欄の合計額と一致する。

[加える。]

ll [同左]

11 [略]
12 [略]
13 [略]
14 [略]
15 [略]
16 [略]
17 [略]
18 [略]
19 [略]
20 [略]
21 [略]
22 [略]
23 [略]
24 [略]
25 [略]
26 [略]

【(第二面)～(第十六面) 略】
(第十七面)

【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、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 [略]

b 1欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポンジャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二十五條第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百

27 [同左]
28 [同左]
29 [同左]
30 [同左]
31 [同左]
32 [同左]
33 [同左]
34 [同左]
35 [同左]
36 [同左]
37 [同左]
38 [同左]
39 [同左]
40 [同左]
41 [同左]
42 [同左]
43 [同左]

【(第二面)～(第十六面) 同左】
(第十七面)

【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、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 [同左]

b 1欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポンジャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二十六條第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引について原資産に係るエクスポンジャーの額を計上すること。

四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。)には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

ロ欄には、自金融機関がオ리지ネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合(証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。)には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

d 三欄には、自金融機関がスポンサー(自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。)として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー(自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。)の額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合(証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。)には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

e 六欄には、自金融機関がスポンサーとして関与している合成型証券化取引に係る証券化

ロ欄には、自金融機関がオ리지ネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー(信用リスク削減手法(自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下この面において同じ。))の効果を勘案した後のものとする。)の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

d 三欄からへ欄までには、自金融機関がスポンサー(自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。)として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー(自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。)の額を記載すること。

e 六欄には、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー(信用リスク削減手法の効

エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補完、流動性補完その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 略]

h ロ欄又はホ欄には、合成型証券化取引における、信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下このhにおいて同じ。）の効果を勘案した後のエクスポージャーの額を記載すること。また、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合で、当該プロテクションを売却したときには、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i～] 略]

(第十八面)

【表略】

a [略]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる事項に該当する者をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー

果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 同左]

h イ合成型証券化取引において、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合、当該プロテクションの効果を勘案した後のエクスポージャーの額をロ欄又はホ欄に計上すること。また、自金融機関が当該プロテクションを売却した場合、当該売却分のプロテクションの額はチ欄に計上すること。

[i～] 同左]

(第十八面)

【同左】

a [同左]

b イ欄には、自金融機関がオリジネーター（自己資本比率告示第一条第六十八号イ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号イに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記

の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

。ロ欄には、自金融機関がオリジネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャーの合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。）には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

d 三欄には、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合（証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各

載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

。ロ欄には、自金融機関がオリジネーターとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（信用リスク削減手法（自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下この面において同じ。）の効果を勘案した後のものとする。）の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

d 三欄からへ欄までには、自金融機関がスポンサー（自己資本比率告示第一条第六十八号ロ又は持株自己資本比率告示第一条第六十八号ロに掲げる場合をいう。以下この面において同じ。）として関与している資産譲渡型証券化取引に係る証券化エクスポージャー（自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。）の額を記載すること。

号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。)には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

e ホ欄には、自金融機関がスポンサーとして関与している合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー (自金融機関が当該証券化取引について提供している信用補充、流動性補充その他の信用供与に係るエクスポージャーを含む。) の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十七条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項第六号、第八号、第九号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合 (証券化取引に係る契約に早期償還条項が含まれている場合には、自己資本比率告示第二百四十七条第三項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第三項各号に掲げる条件の全てを満たさないときを含む。) には、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 略]

h ロ欄又は本欄には、合成型証券化取引における、信用リスク削減手法 (自己資本比率告示第八十条第一項又は持株自己資本比率告示第五十八条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下このhにおいて同じ。) の効果を勘案した後のエクスポージャーの額を記載すること。また、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合で、当該プロテクションを売却したときには、当該売却分のプロテクションの額は本欄に計上すること。

[i〜] 略]

e ホ欄には、合成型証券化取引に係る証券化エクスポージャー (信用リスク削減手法の効果を勘案した後のものとする。) の合計額を記載すること。ただし、自己資本比率告示第二百四十八条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号又は持株自己資本比率告示第二百二十六条第一項第六号、第七号若しくは第二項各号に掲げる条件のいずれかを満たさない場合、当該取引については原資産に係るエクスポージャーの額を計上すること。

[f・g 同左]

h 合成型証券化取引において、自金融機関が信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブによるプロテクションを取得している場合、当該プロテクションの効果を勘案した後のエクスポージャーの額をロ欄又は本欄に計上すること。 また、自金融機関が当該プロテクションを売却した場合、当該売却分のプロテクションの額は本欄に計上すること。

[i〜] 同左]

(第十九面)

(単位：百万円)

SBC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）		イ		【略】
項番	[略]	合計]
		[略]		
【略】				
エクスポージャーの額（算出方法別）				
6	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー			
7	外部格付 <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー			
8	<u>標準的</u> 手法 <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー			
9	<u>1250%</u> 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			
信用リスク・アセットの額（算出方法の別）				
10	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			
11	外部格付 <u>準備方式</u> により算出した信用リスク・アセット			

(第十九面)

(単位：百万円)

SBC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）		イ		【同左】
項番	[同左]	合計		左]
		[同左]		
エクスポージャーの額（算出方法別）				
6	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー			
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー			
8	<u>標準的</u> 手法が適用される証券化エクスポージャー			
9	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項の規定により <u>1250%</u> 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			
信用リスク・アセットの額（算出方法の別）				
10	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット			

12	標準的手法 <u>準備方式</u> により算出した信用リスク・アセット	
13	<u>1250%</u> 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に係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法準備方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
15	<u>外部格付準備方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
16	<u>標準的手法準備方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
17	<u>1250%</u> 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に係る所要自己資本	

(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、自己資本比率報告書及び持株自己資本比率報告書において使用する用語の例によるものとする。

[a～c 略]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に並び、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率報告書第二百

12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	
13	自己資本比率報告書 <u>第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率報告書<u>第二百五条第一項の規定</u>により<u>1250%</u>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に係る信用リスク・アセット</u>	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法における外部格付準備方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
15	<u>内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
16	<u>標準的手法が適用される証券化エクスポージャー</u> に係る所要自己資本	
17	自己資本比率報告書 <u>第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率報告書<u>第二百五条第一項の規定</u>により<u>1250%</u>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に係る所要自己資本</u>	

(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、自己資本比率報告書及び持株自己資本比率報告書において使用する用語の例によるものとする。

[a～c 同左]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に並び、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率報告書第二百

六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限及び自己資本比率告示第二百四十八條の第二項又は持株自己資本比率告示第二百二十六條の第二項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

Ⓕ 項番9 「1250%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」、項番13 「1250%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に係る信用リスク・アセット」及び項番17 「1250%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に係る所要自己資本」の項には、そのリスク・ウェイトの算出方式につき内部格付準拠方式、外部格付準拠方式、内部評価手法又は標準的準拠方式のいずれも用いることなく1250%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に係る計数を記載すること。

Ⓖ 項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。)又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。)に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。)又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。)に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限及び自己資本比率告示第二百五十五條第一項又は持株自己資本比率告示第二百三十三條第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

【加える。】

Ⓕ 項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項

⌚ 項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番11「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、外部格付準拠方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌛ 項番12「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番12「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、標準的手法準拠方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌜ 項番13「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番13「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌝ 項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十面の項番14「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクス

ポートジャーの額と一致する。

⌞ 項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番11「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌟ 項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番12「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、標準的手法適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌠ 項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第二十面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

⌡ 項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第二十面の項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13「信用リスク・アセットの額

スポンジヤーのうち、内部格付手法進捗方式又は内部評価方式適用分」の項への額と一致する。

⌚ 項番15「外部格付進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番15「外部格付進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付進捗方式適用分」の項への額と一致する。

⌛ 項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項への額と一致する。

⌜ 項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項への額と一致する。

⌝ [略]
⌞ [略]

の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付進捗方式又は内部評価方式適用分」の項への額と一致する。

⌚ 項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項への額と一致する。

⌛ 項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」の項への額と一致する。

⌜ 項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項への額及び第二十面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項への額と一致する。

⌝ [同左]
⌞ [同左]

(第二十面)

(単位：百万円)

SBC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）		イ		【略】
項番	[略]	合計]
		[略]		
	エクスポージャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー			
7	外部格付 <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー			
8	<u>標準的</u> 手法 <u>準備方式</u> が適用される証券化エクスポージャー			
9	<u>1250%</u> 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			
	信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			
11	外部格付 <u>準備方式</u> により算出した信用リスク・アセット			

(第二十面)

(単位：百万円)

SBC 4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する 所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）		イ		【同左】
項番	[同左]	合計		左]
		[同左]		
	エクスポージャーの額（算出方法別）			
6	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー			
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー			
8	<u>標準的</u> 手法が適用される証券化エクスポージャー			
9	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百五条第一項の規定により <u>1250%</u> 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			
	信用リスク・アセットの額（算出方法の別）			
10	内部格付手法における外部格付 <u>準備方式</u> 又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット			
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット			

12	標準的手法 準拠 方式により算出した信用リスク・アセット	
13	<u>1250%</u> のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法準拠</u> 方式又は 内部評価 方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
15	<u>外部格付準拠</u> 方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
16	標準的手法 準拠 方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
17	<u>1250%</u> のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	

(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～c 略]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率告示第二百

12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	
13	自己資本比率告示第二百四十七条 第一項の規定 又は持株自己資本比率告示第二百二十五条 第一項の規定 により1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	
	所要自己資本の額 (算出方法別)	
14	<u>内部格付手法</u> における外部格付準拠方式又は 内部評価 方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
15	<u>内部格付手法</u> における 指定関数 方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	
17	自己資本比率告示第二百四十七条 第一項の規定 又は持株自己資本比率告示第二百二十五条 第一項の規定 により1250%のリスク・ウエイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	

(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～c 同左]

d 「信用リスク・アセットの額 (算出方法別)」の項番10から項番13までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の信用リスク・アセットの額 (自己資本比率告示第二百

六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百六十七條又は持株自己資本比率告示第二百四十五條に規定するリスク・ウェイトに関する上限及び自己資本比率告示第二百四十八條の第二項又は持株自己資本比率告示第二百二十六條の第二項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

Ⓕ 項番9 「1250%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」、項番13 「1250%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に係る信用リスク・アセット」及び項番17 「1250%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に係る所要自己資本」の項には、そのリスク・ウェイトの算出方式につき内部格付準拠方式、外部格付準拠方式、内部評価手法又は標準的準拠方式のいずれも用いることなく1250%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に係る計数を記載すること。

Ⓖ 項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番10 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。)又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。)に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限を適用する前の額)を記載すること。

- 「所要自己資本の額(算出方法別)」の項番14から項番17までの項には、証券化取引の種類に応じ、算出方法別の所要自己資本の額(自己資本比率告示第二百五十二條第一項(自己資本比率告示第二百七十七條第一項において適用する場合を含む。)又は持株自己資本比率告示第二百三十條第一項(持株自己資本比率告示第二百四十八條第一項において適用する場合を含む。)に規定する信用リスク・アセットの額に関する上限及び自己資本比率告示第二百五十五條第一項又は持株自己資本比率告示第二百三十三條第一項に規定する所要自己資本の額に関する上限を適用した後の額)を記載すること。

【加える。】

Ⓕ 項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番10 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項

Ⓙ 項番11 「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番11 「外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、外部格付準拠方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

Ⓚ 項番12 「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番12 「標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、標準的手法準拠方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

Ⓛ 項番13 「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番13 「1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

Ⓜ 項番14 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第十九面の項番14 「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクス

ポートジャーの額と一致する。

Ⓨ 項番11 「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番11 「内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番14 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額と一致する。

Ⓩ 項番12 「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番12 「標準的手法により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番15 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、標準的手法適用分」の項イ欄の額と一致する。

ⓐ 項番13 「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額及び第十九面の項番13 「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーに係る信用リスク・アセット」の項イ欄の額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャー うち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額と一致する。

ⓑ 項番14 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額及び第十九面の項番14 「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の額の合計額は、第一面の項番13 「信用リスク・アセットの額

スポンジジャーのうち、内部格付手法進捗方式又は内部評価方式適用分」の項への額と一致する。

㊦ 項番15「外部格付進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番15「外部格付進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、外部格付進捗方式適用分」の項への額と一致する。

㊧ 項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番16「標準的手法進捗方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項への額と一致する。

㊨ 項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項への額と一致する。

㊩ [略]

㊪ [略]

の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付進捗方式又は内部評価方式適用分」の項への額と一致する。

㊦ 項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番15「内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項への額と一致する。

㊧ 項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番16「標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、標準的手法適用分」の項への額と一致する。

㊨ 項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項への額及び第十九面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は持株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項への額の合計額は、第一面の「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項への額と一致する。

㊩ [同左]

㊪ [同左]

〔第二十一面〕～〔第二十五面〕 略

(別紙様式第八号)

(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	
		リスク・アセット	
		当四半期末	前四半期末
[略]			
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつて いる証券化エクスポート ジャー		
13	うち、 <u>内部格付手法</u> 適用方式又は 内部評価方式 適用分		
	うち、 <u>外部格付</u> 適用方式適用分		
14	うち、 <u>標準的手法</u> 適用方式適用分		
	うち、 <u>1250%のリスク・ウェイト</u> 適用分		
15			
[略]			

〔第二十一面〕～〔第二十五面〕 同左

(別紙様式第八号)

(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	
		リスク・アセット	
		当四半期末	前四半期末
[同左]			
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となつて いる証券化エクスポート ジャー		
13	うち、 <u>内部格付手法</u> における 外部格付 適用方式又は 内部評価方式 適用分		
	うち、 <u>内部格付手法</u> における 指定関数 方式適用分		
14	うち、 <u>標準的手法</u> 適用分		
	うち、 <u>1250%のリスク・ウェイト</u> 適用分		
15			
[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~aa 略]

bb 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法準拠方式又は内部評価方式」により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法準拠方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及びニ欄の「前四半期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

dd 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、外部格付準拠方式適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする

(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~aa 同左]

bb 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番10「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式」により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

cc 項番13「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番14「内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

dd 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末

中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「外部格付進捗方式」により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、外部格付進捗方式適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「外部格付進捗方式」が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前四半期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

ff 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法進捗方式」により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

gg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法進捗方式適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法進捗方式」が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。なお、ロ欄及び三欄の「前四半期末」が平成三十二

年中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番11「内部格付手法」における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ee 項番14「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、内部格付手法」における指定関数方式適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番15「内部格付手法」における指定関数方式が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

ff 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番12「標準的手法」により算出した信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

gg 項番15「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポートジャーのうち、標準的手法適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番16「標準的手法」が適用される証券化エクスポートジャーに係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

年三月三十一日前となる場合には、当該欄は記載することを要しない。

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「1250%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に係る信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

jj 項番13から項番15までの項のロ欄及びニ欄の「前四半期末」が平成三十一年三月三十一日前となる場合には、項番15と「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項との間に「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分」、「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、内部格付手法における指定関数方式適用分」及び「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化

hh 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項イ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番13「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は特株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る信用リスク・アセット」の項イ欄の合計額と一致する。

ii 「信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーのうち、1250%のリスク・ウェイト適用分」の項ハ欄の額は、当四半期末を期末とする事業年度に係る別紙様式第二号第二十四面及び第二十五面の開示又は当四半期末を中間期末とする中間期に係る別紙様式第四号第十九面及び第二十面の開示を行う場合、それぞれの面の項番17「自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定又は特株自己資本比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%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に係る所要自己資本」の項イ欄の合計額と一致する。

【加える。】

エクスポートジャー うち、標準的手法適用分」との名称の項（項番を付さないこと。）を追加すること。この場合においては、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（平成三十一年金融庁告示第 号）第●条の規定による改正後の銀行法施行規則第十九条の二第一項第五号二等の規定に基づき、自己資本の充実の状況等について金融庁長官が別に定める事項の規定にかかわらず、追加するこれらの項のロ欄及びニ欄の「前四半期末」の記載は、なお従前の例によること（なお、イ欄及びハ欄は記載することは要しない。）。

kk [略]
ll [略]
mm [略]
nn [略]
oo [略]
pp [略]
qq [略]
rr [略]
ss [略]
tt [略]

【（第二面）～（第四面） 略】

jj [同左]
kk [同左]
ll [同左]
mm [同左]
nn [同左]
oo [同左]
pp [同左]
qq [同左]
rr [同左]
ss [同左]

【（第二面）～（第四面） 同左】

備考 表中の「」の記載は注記びある。