

○ 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（平成二十二年度金融庁告示第一三二号）

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）平成三十年六月十八日公表の改正案適用後のもの。

| 改正後   | 改正前（注）  |
|---|---|
| <p>（事業年度の記載事項）</p> <p>第三条 「略」</p> <p>〔2・3 略〕</p> <p>4 第一項の定量的な開示事項は、次に掲げる事項とする。</p> <p>〔一・二 略〕</p> <p>三   リスク・ウェイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウェイトを算出することを行う。）又は信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を算出することを行う。）が適用されるエクスポージャーについて、次に掲げるエクスポージャーの区分ごとの額</p> <p>イ  連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第二項の規定によ</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・二 同上〕</p> <p>三   次のイ又はロに掲げる場合の区分に応じ、当該イ又はロに定める額</p> <p>イ 標準的手法を採用した場合 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないもの額</p> <p>ロ 内部格付手法を採用した場合 信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により</p> |

- り算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は連結自己資本規制比率告示第四百四十二条第二項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー
- ロ 連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第六項の規定により算出した割合をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は連結自己資本規制比率告示第四百四十二条第七項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー
- ハ 連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第一号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は連結自己資本規制比率告示第四百四十二条第十号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー
- ニ 連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第二号に定める比率をリスク・ウェイトとして用いるエクスポージャー又は連結自己資本規制比率告示第四百四十二条第十項第二号に定めるリスク・ウェイトを用いて信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー
- ホ 連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第十項のリスク・ウェイトを用いるエクスポージャー又は連結自己資本規制比率告示第四百四十二条第十一項の規定により信用リスク・アセットの額を算出するエクスポージャー

〔5〕7 略〕

信用リスク・アセットの額を算出することをいう。）が適用されるエクスポージャーの額

〔5〕7 同上〕

(別紙様式第二号)

(第一面)

(単位：百万円)

| OV 1：リスク・アセットの概要 |  |     |        |     |     |
|------------------|--|-----|--------|-----|-----|
| 国際様式の該当番号        | イ  | ロ   | ハ      |     |     |
|                  |  |     | ニ      |     |     |
|                  |  |     | 所要自己資本 |     |     |
| リスク・アセット         |  | 当期末 | 前期末    | 当期末 | 前期末 |
| [略]              |  |     |        |     |     |
| 8                | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式) |     |        |     |     |
| 9                | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マंडレ)      |     |        |     |     |

(別紙様式第二号)

(第一面)

(単位：百万円)

| OV 1：リスク・アセットの概要 |                          |     |        |     |     |
|------------------|--------------------------|-----|--------|-----|-----|
| 国際様式の該当番号        | イ                        | ロ   | ハ      |     |     |
|                  |                          |     | ニ      |     |     |
|                  |                          |     | 所要自己資本 |     |     |
| リスク・アセット         |                          | 当期末 | 前期末    | 当期末 | 前期末 |
| [同左]             |                          |     |        |     |     |
|                  | 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー |     |        |     |     |

|     |   |  |  |  |  |  |
|-----|---|--|--|--|--|--|
|     | ート方式)   |  |  |  |  |  |
|     | リスク・ウエイトのみなし<br>計算又は信用リスク・アセ<br>ットのみなし計算 (蓋然性<br>方式250%)      |  |  |  |  |  |
|     | リスク・ウエイトのみなし<br>計算又は信用リスク・アセ<br>ットのみなし計算 (蓋然性<br>方式400%)      |  |  |  |  |  |
| 10  | リスク・ウエイトのみなし<br>計算又は信用リスク・アセ<br>ットのみなし計算 (フノー<br>ルバツク方式1250%) |  |  |  |  |  |
| [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~r 略]

|      |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|
|      |  |  |  |  |  |
|      | 信用リスク・アセットのみな<br>し計算が適用されるエクスポ<br>ージャー |  |  |  |  |
| [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~r 同左]

㉔ 項番8「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第二項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第二項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

㉕ 項番9「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（バズゲート方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第六項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第七項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

㉖ 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第一号の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十項第一号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、ロ欄及びニ欄の「前期末」が平

㉔ 「複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー」の項には、標準的手法を採用した場合にあつては、リスク・ウエイトを直接に判定することができないものの信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

㉕ 「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」の項には、連結自己資本規制比率告示第四百四十四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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[加える。]

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。

㉔ 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算

(蓋然性方式400%)」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつて

は連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第二号の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十項第二号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

[加える。]

㉕ 項番10「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)」の項には、標準的手法採用最終指定

[加える。]

親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第十項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十一項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

㉖ [略]

㉖ [同左]

㉗ [略]

㉗ [同左]

㉘ [略]

㉘ [同左]



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 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産の額」及び項番 2 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく負債の額」の項へ欄からホ欄までには、それぞれ第二面の「資産合計」及び「負債合計」の項へ欄から〜欄までの対応する項目の額を記載すること。また、項番 1 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産の額」及び項番 2 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく負債の額」の項へ欄には、それぞれ第二面の「資産合計」及び「負債合計」の項へ欄から上欄の額を控除した額を記載すること。

[b～f 略]

(第四面)

【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、リースク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリースク・ウエイトを算出することをいう。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算すること）をいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～p 略]

(第五面)

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 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産の額」及び項番 2 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく負債の額」の項へ欄からホ欄までには、それぞれ第二面の「資産合計」及び「負債合計」の項へ欄から〜欄までの対応する項目の額を記載すること。また、項番 1 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産の額」及び項番 2 「連結自己資本規制上の連結範囲に基づく負債の額」の項へ欄には、それぞれ第二面の「資産合計」及び「負債合計」の項へ欄から上欄までの額を控除した額を記載すること。

[b～f 同左]

(第四面)

【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、複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー（リースク・ウエイトを直接に判定することができないものをいう。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算すること）をいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～p 同左]

(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、カウンタパーテイ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、リスク・ウェイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウェイトを算出することをいう。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～i 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、カウンタパーテイ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、リスク・ウェイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウェイトを算出することをいう。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 略]

【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、カウンタパーテイ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、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。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～i 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、カウンタパーテイ信用リスク、証券化取引に係る信用リスク、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。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 同左]

(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リースク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリースク・ウエイトを算出することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～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リースク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリースク・ウエイトを算出することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～z 略]

【(第九面)～(第十三面) 略】  
(第十四面)

(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（リースク・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～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（リースク・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～z 同左]

【(第九面)～(第十三面) 同左】  
(第十四面)

(単位：百万円)

| 項番  | COR 1：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 |     |       |  |  |                    |
|-----|------------------------------------|-----|-------|--|--|--------------------|
|     | イ                                  | ロ   | ハ     | ニ  | ホ  | ヘ                  |
| [略] | RC                                 | PFE | 実効EPE | 規制上の<br>エクスポ<br>ージャー<br>の算定に<br>使用され<br>る $\alpha$ | 信用リス<br>ク削減手<br>法適用後<br>のエク<br>スポー<br>ジャ | リスク・<br>アセット<br>の額 |
|     | [略]                                |     |       |  |  |                    |

【(注) 略】

【(第十五面)～(第三十二面) 略】

(別紙様式第四号)

(第一面)

(単位：百万円)

(単位：百万円)

| 項番   | COR 1：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 |      |       |  |  |                    |
|------|------------------------------------|------|-------|--|--|--------------------|
|      | イ                                  | ロ    | ハ     | ニ  | ホ  | ヘ                  |
| [同左] | 再構築コ<br>スト                         | アドオン | 実効EPE | 規制上の<br>エクスポ<br>ージャー<br>の算定に<br>使用され<br>る $\alpha$ | 信用リス<br>ク削減手<br>法適用後<br>のエク<br>スポー<br>ジャ | リスク・<br>アセット<br>の額 |
|      | [同左]                               |      |       |  |  |                    |

【(注) 同左】

【(第十五面)～(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 |          |       |        |       |
|-----------|----------|-------|--------|-------|
|           | イ        | ロ     | ハ      | ニ     |
|           | リスク・アセット |       | 所要自己資本 |       |
|           | 当中間期末    | 前中間期末 | 当中間期末  | 前中間期末 |

[略]

|   |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|
| 8 | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式) |  |  |  |  |
| 9 | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マゾダート方式)   |  |  |  |  |
|   | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセ                     |  |  |  |  |

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 |       | 所要自己資本 |       |
|           | 当中間期末    | 前中間期末 | 当中間期末  | 前中間期末 |

[同左]

|  |                          |  |  |  |  |
|--|--------------------------|--|--|--|--|
|  | 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー |  |  |  |  |
|--|--------------------------|--|--|--|--|

|     |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|
|     | ツトのみなし計算（蓋然性方式250%）                              |  |  |  |  |
|     | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）      |  |  |  |  |
| 10  | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フオールバック方式1250%） |  |  |  |  |
| [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~r 略]

⑤ 項番8「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第二項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四

|      |                                |  |  |  |  |
|------|--------------------------------|--|--|--|--|
|      | 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 |  |  |  |  |
| [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~r 同左]

⑤ 「複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー」の項には、標準的手法を採用した場合にあつては、リスク・ウエイトを直接に判定することができないものの信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

条第二項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

± 項番9「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ノンゼット方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第六項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第七項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

± 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第一号の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十項第一号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要しない。

± 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算

± 「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」の項には、連結自己資本規制比率告示第四百四十四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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[加える。]

[加える。]

(蓋然性方式100%)」の項には、標準的手法採用最終指定親会社において  
は連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第二号の規定、内部格付  
手法採用最終指定親会社において(は連結自己資本規制比率告示第四百四十四  
条第十項第二号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・アセツ  
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(ハ欄及  
びニ欄)をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載することを要  
しない。

㉔ 項番10「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセツトのみな

し計算(フォールバック方式1250%)」の項には、標準的手法採用最終指定  
親会社において(は連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第十項の規定、  
内部格付手法採用最終指定親会社において(は連結自己資本規制比率告示第  
百四十四条第十一項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・ア  
セツトの額の合計額(イ欄及びロ欄)及びこれに係る所要自己資本の額(ハ  
欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。ただし、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、当該欄は記載すること  
を要しない。

[加える。]

㉕ [略]  
㉖ [略]  
㉗ [略]  
㉘ [略]  
㉙ [略]  
㉚ [略]  
㉛ [略]

㉕ [同左]  
㉖ [同左]  
㉗ [同左]  
㉘ [同左]  
㉙ [同左]  
㉚ [同左]  
㉛ [同左]



四の規定によりリスク・ウエイトを算出することをいう。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～p 略]

(第三面)

【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、リスク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウエイトを算出することをいう。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～i 略]

(第四面)

【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

を直接に判定することができないものをいう。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～p 同左]

(第三面)

【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、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。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～i 同左]

(第四面)

【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、リスク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウエイトを算出することを行う。）及び信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 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リスク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条の四の規定によりリスク・ウエイトを算出することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～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リスク・ウエイトのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四十三条

スク、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。）並びに信用リスク・アセットのみなし計算（連結自己資本規制比率告示第四百四十四条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

[a～m 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～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・ウエイ

の四の規定によりリスク・ウェイトを算出することをいう。)に係る信用リスクは対象外とする。

[a～z 略]

【(第七面)～(第九面) 略】  
(第十面)

(単位：百万円)

|                                    |    |     |       |                                |                       |            |
|------------------------------------|----|-----|-------|--------------------------------|-----------------------|------------|
| CCR 1：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          |
|                                    | RC | PPE | 実効EPE | 規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$ | 信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー | リスク・アセットの額 |
| [略]                                |    |     |       |                                |                       |            |

【(注) 略】

【(第十一面)～(第二十五面) 略】

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～z 同左]

【(第七面)～(第九面) 同左】  
(第十面)

(単位：百万円)

|                                    |        |      |       |                                |                       |            |
|------------------------------------|--------|------|-------|--------------------------------|-----------------------|------------|
| CCR 1：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 | アドオン | 実効EPE | 規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$ | 信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー | リスク・アセットの額 |
| [同左]                               |        |      |       |                                |                       |            |

【(注) 同左】

【(第十一面)～(第二十五面) 同左】

(別紙様式第六号)

(第一面)

(単位：百万円)

| OV 1：リスク・アセットの概要  |  |  |           |  |           |  |           |  |
|-------------------|--|--|-----------|--|-----------|--|-----------|--|
| 国際様式<br>の該<br>当番号 | イ  |  | ロ         |  | ハ         |  | ニ         |  |
|                   | リスク・アセット   |  |           |  | 所要自己資本    |  |           |  |
|                   | 当四半期<br>末  |  | 前四半期<br>末 |  | 当四半期<br>末 |  | 前四半<br>期末 |  |
| [略]               |  |  |           |  |           |  |           |  |
| 8                 | リスク・ウエイトのみなし<br>計算又は信用リスク・アセ<br>ットのみなし計算 (ルック<br>・スルー方式) |  |           |  |           |  |           |  |
| 9                 | リスク・ウエイトのみなし   |  |           |  |           |  |           |  |

(別紙様式第六号)

(第一面)

(単位：百万円)

| OV 1：リスク・アセットの概要  |                              |  |           |  |           |  |           |  |
|-------------------|------------------------------|--|-----------|--|-----------|--|-----------|--|
| 国際様式<br>の該<br>当番号 | イ                            |  | ロ         |  | ハ         |  | ニ         |  |
|                   | リスク・アセット                     |  |           |  | 所要自己資本    |  |           |  |
|                   | 当四半期<br>末                    |  | 前四半期<br>末 |  | 当四半<br>期末 |  | 前四半<br>期末 |  |
| [同左]              |                              |  |           |  |           |  |           |  |
|                   | 複数の資産及び取引を裏付け<br>とするエクスポージャー |  |           |  |           |  |           |  |

|    |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|
|    | 計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マージネット方式）                     |  |  |  |  |
|    | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）        |  |  |  |  |
|    | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）        |  |  |  |  |
| 10 | リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フオーレバティック方式1250%） |  |  |  |  |

【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

|  |                                |  |  |  |  |
|--|--------------------------------|--|--|--|--|
|  |                                |  |  |  |  |
|  | 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 |  |  |  |  |

【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~r 略]

㊦ 項番8 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第二項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第二項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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。

㊧ 項番9 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ワンズード方式）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第六項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第七項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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。

㊨ 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第一号の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条

率告示において使用する用語の例によるものとする。

[a~r 同左]

㊦ 「複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー」の項には、標準的手法を採用した場合にあつては、リスク・ウエイトを直接に判定することができないものの信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

㊧ 「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」の項には、連結自己資本規制比率告示第四百四十四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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

[加える。]

第十項第一号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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。

㍷ 「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算

（蓋然性方式400%）」の項には、標準的手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第九項第二号の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十項第二号の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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。

[加える。]

㍸ 項番10「リスク・ウエイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フオーパルバツク方式1250%）」の項には、標準的手法採用最終指定

[加える。]

親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四十三条の四第十項の規定、内部格付手法採用最終指定親会社にあつては連結自己資本規制比率告示第四百四十四条第十一項の規定を適用するエクスポージャーに係る信用リスク・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（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。ただし、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。

ㄹ [略]  
 ㄺ [略]  
 ㄻ [略]  
 ㄼ [略]  
 ㄽ [略]  
 ㄾ [略]  
 ㄿ [略]  
 ㅀ [略]  
 ㅁ [略]  
 ㅂ [略]  
 ㅃ [略]  
 ㅄ [略]  
 ㅅ [略]  
 ㅆ [略]  
 ㅈ [略]  
 ㅊ [略]  
 ㅋ [略]  
 ㆁ [略]

[ (第二面) ~ (第四面) 略 ]

ㅁ [同左]  
 ㅂ [同左]  
 ㅃ [同左]  
 ㅄ [同左]  
 ㅅ [同左]  
 ㅆ [同左]  
 ㅇ [同左]  
 ㅈ [同左]  
 ㅊ [同左]  
 ㅋ [同左]  
 ㆁ [同左]  
 ㆂ [同左]  
 ㆃ [同左]  
 ㆄ [同左]  
 ㆅ [同左]  
 ㆆ [同左]  
 ㆇ [同左]  
 ㆈ [同左]  
 ㆉ [同左]  
 ㆊ [同左]  
 ㆋ [同左]  
 ㆌ [同左]  
 ㆍ [同左]

[ (第二面) ~ (第四面) 同左 ]

備考 表中の「」の記載及び対象規定の二重傍線を付した標記部分を除く全体に付した傍線は注記である。