

○ 銀行法施行規則第十九条の二第一項第五号ニ等の規定に基づき、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（平成二十九年金融庁告示第四十五号第一条の規定による改正後のもの（未施行））

<p>(別紙様式第二号)</p> <p style="text-align: right;">(第一面)</p> <p style="text-align: center;">(単位：百万円)</p> <p><b>0V1：リスク・アセットの概要</b></p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td rowspan="2" style="width: 20%;">国際様式の該当番号</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> </tr> <tr> <td>イ</td> <td>ロ</td> <td>ハ</td> <td>ニ</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>リスク・アセット</td> <td>所要自己資本</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>当期末</td> <td>前期末</td> <td>当期末</td> <td>前期末</td> <td></td> <td></td> </tr> </table> <p>[略]</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 5%;">4</td> <td style="width: 15%;">カウンターパーティ信用リスク</td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">5</td> <td>うち、SA-CCR適用分</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </table> <p>[項を削る。]</p>	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			4	カウンターパーティ信用リスク					5	うち、SA-CCR適用分					<p>(別紙様式第二号)</p> <p style="text-align: right;">(第一面)</p> <p style="text-align: center;">(単位：百万円)</p> <p><b>0V1：リスク・アセットの概要</b></p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td rowspan="2" style="width: 20%;">国際様式の該当番号</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> </tr> <tr> <td>イ</td> <td>ロ</td> <td>ハ</td> <td>ニ</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>リスク・アセット</td> <td>所要自己資本</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>当期末</td> <td>前期末</td> <td>当期末</td> <td>前期末</td> <td></td> </tr> </table> <p>[同左]</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 5%;">4</td> <td style="width: 15%;">カウンターパーティ信用リスク</td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%;"></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">5-1</td> <td>うち、カレント・エクスポージャー方式適用分</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">5-2</td> <td>うち、標準方式適用分</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </table>	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		4	カウンターパーティ信用リスク					5-1	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分					5-2	うち、標準方式適用分				
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																																																																													
4	カウンターパーティ信用リスク																																																																																
5	うち、SA-CCR適用分																																																																																
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																																																																													
4	カウンターパーティ信用リスク																																																																																
5-1	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分																																																																																
5-2	うち、標準方式適用分																																																																																

【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～j 略]

k 項番5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SA-CCR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二（持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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●●年金融庁告示第●●号。以下この面及び第十四面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。）附則第二條第一項又は第四條第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・エクスポート方式を用いる場合には、項番5と項番6との間に「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」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、当該項には、自己資本比率告示第七十九条の四（平成●●年金融庁告示第●●号 附則第二條第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第百五十七条第

【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～j 同左]

k 項番5-1 「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二（持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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 「カウンターパーティ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三（自己資本比率告示第百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三（持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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。

五項及び第六十五条第五項において読み替えて準用する場合を含む。)の規定又は持  
株自己資本比率告示第五十七条の四(平成●●年金融庁告示第●号附則第四条第一項  
の規定により読み替えて適用する持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百  
四十三条第五項において読み替え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 項番6 「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分  
」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三(自己資本比率告示第百五十七条第五  
項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比  
率告示第五十七条の三(持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三  
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レ  
ボ形式の取引等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  
。

[n～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、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。

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

m 項番6 「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分  
」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四(自己資本比率告示第百五十七条第五  
項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比  
率告示第五十七条の四(持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三  
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レ  
ボ形式の取引等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  
。

[n～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、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。

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、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。

この面においては、カウンタートパーテイ信用リスク、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

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、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。

この面においては、カウンタートパーテイ信用リスク、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

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。

[j~z 略]

【(第九面) ~ (第十三面) 略】  
(第十四面)

(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	実効EP	規制上のエクスポージャーの算定に使用される	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセツトの額	
1	SA-C CR			E	1.4			
[項を削る。]								
[略]								

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 同左]

【(第九面) ~ (第十三面) 同左】  
(第十四面)

(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	実効EP	規制上のエクスポージャーの算定に使用される	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセツトの額	
1-1	カレント ・エクス ポージャー 方式			E	1.4			
1-2	標準方式							
[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 項番 1 「SA-C-C-R」の項には、自己資本比率告示第七十九条のこの規定又は持株自己資本比率告示第五十七条のこの規定により SA-C-C-R を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第二項及び第十七項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第六項及び第十八項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第六項及び第十八項の規定により算出する額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

b 平成●●年金融庁告示第●●号附則第二条第一項又は第四条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・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、自己資本比率告示第七十九条の四の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四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、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第三項各号に掲げ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。

o 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三の規定により期待エクスポージャー

(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 項番 1-1 「カレント・エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条のこの規定又は持株自己資本比率告示第五十七条のこ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、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第三項各号に掲げる額を、それぞれ記載すること。

b 項番 1-2 「標準方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三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、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第一項第一号又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第一項第一号の算式において 1.4 を乗ずる前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

o 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四の規定により期待エクスポージャー

方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の三第二項第一号の算式において用いる $\alpha$ 又は自己資本比率告示第七十九条の三第四項の規定若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の三第四項の規定により独自に推計した $\alpha$ を、それぞれ記載すること。

[d～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、当該項の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、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 項番1「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の三又は持株自己資本比率告示第五十七条の三に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の四第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項第一号の算式において用いる $\alpha$ 又は自己資本比率告示第七十九条の四第四項の規定若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の四第四項の規定により独自に推計した $\alpha$ を、それぞれ記載すること。

[d～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、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 項番1「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の四又は持株自己資本比率告示第五十七条の四に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 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、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～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、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)

0V1：リスク・アセットの概要				
国際様式 の該当番				
	イ	ロ	ハ	ニ
				所要自己資本

[b～i 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、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～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、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)

0V1：リスク・アセットの概要				
国際様式 の該当番				
	イ	ロ	ハ	ニ
				所要自己資本



号	当中間 前中間 当中間 前中間			
	期末	期末	期末	期末
[略]				
4	カウンターパーティ信用リスク			
5	うち、SA-CCR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、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~j 略]

k 項番 5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SA-CCR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は特殊自己資本比率告示第五十七条の二（特殊自己資本比率告示第三百五十五条第五項及び第四百三十三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

号	当中間 前中間 当中間 前中間			
	期末	期末	期末	期末
[同左]				
4	カウンターパーティ信用リスク			
5-1	うち、カレント・エクスポート方式適用分			
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、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~j 同左]

k 項番 5-1 「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は特殊自己資本比率告示第五十七条の二（特殊自己資本比率告示第三百五十五条第五項及び第四百三十三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 「カウンターパーティ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三（自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第六十

成●●年金融庁告示第●●号。以下この面及び第十面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。) 附則第二条第一項又は第四条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・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」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、自己資本比率告示第七十九条の四(平成●●年金融庁告示第●●号附則第二条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第五十七条第五項及び第六十五条第五項において読み替えて適用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四(平成●●年金融庁告示第●●号附則第四条第一項の規定により読み替えて適用する持株自己資本比率告示第三百三十五条第五項及び第四百十三条第五項において読み替えて適用する場合を含む。)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 項番6「カウンターパーティー信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三(自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第六十五条第五項において適用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三(持株自己資本比率告示第三百三十五条第五項及び第四百十三条第五項において適用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及びレボ形式の取引等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。

五条第五項において適用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三(持株自己資本比率告示第三百三十五条第五項及び第四百十三条第五項において適用する場合を含む。)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 項番6「カウンターパーティー信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四(自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第六十五条第五項において適用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四(持株自己資本比率告示第三百三十五条第五項及び第四百十三条第五項において適用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及びレボ形式の取引等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>[n～pp 略]</p> <p>【(第二面)～(第四面) 略】</p> <p>(第五面)</p>	<p>[n～pp 同左]</p> <p>【(第二面)～(第四面) 同左】</p> <p>(第五面)</p>
<p>【表略】</p> <p>(注)</p> <p>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。</p> <p>この面においては、カウンターパーティー信用リスク、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。</p>	<p>【同左】</p> <p>(注)</p> <p>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。</p> <p>この面においては、カウンターパーティー信用リスク、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。</p>
<p>[a～m 略]</p> <p>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、<u>多数国間投資保証機関</u>、<u>国際開発協会</u>、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、<u>欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行</u>を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。</p> <p>[o～gg 略]</p> <p>(第六面)</p>	<p>[a～m 同左]</p> <p>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、<u>多数国間投資保証機関</u>、<u>アジア開発銀行</u>、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<u>欧州評議会開発銀行</u>を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。</p> <p>[o～gg 同左]</p> <p>(第六面)</p>
<p>【表略】</p> <p>(注)</p> <p>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。</p>	<p>【同左】</p> <p>(注)</p> <p>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。</p>

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、アフリカ開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州投資銀行、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イسلام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。

[j～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
	再構築	アドオ	実効EP	規制上 のエク スポー	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー	リスク ・アセ ットの 額
	コスト	ソ	E	ジャヤー の算定 の使用		

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、アフリカ開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州投資銀行、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イسلام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 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	アドオ	実効EP	規制上 のエク スポー	信用リ スク削 減手法 適用後 のエク スポー	リスク ・アセ ットの 額
	コスト	ソ	E	ジャヤー の算定 の使用		

	/				される	ジャー		
1	$\frac{SA-C}{CR}$			1.4	$\alpha$			
[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、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 項番 1 「SA-C-CR」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二の規定により SA-C-CR を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第二項及び第十七項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第六項及び第十八項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第六項及び第十八項の規定により算出する額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

b 平成●●年金融庁告示第●号附則第二条第一項又は第四条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・エクスポート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・エクスポートジャー方式」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、自己資本比率

	/				される	ジャー		
1-1	カレント・エクスポートジャー方式				$\alpha$			
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、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 項番 1-1 「カレント・エクスポートジャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二の規定によりカレント・エクスポートジャー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の二第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の二第三項各号に掲げる額を、それぞれ記載すること。

b 項番 1-2 「標準方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三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、ハ欄については自己資本比率告示第七十九条の三第一項第一号又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第一項第一号の算式において 1.4 を乗ずる前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

示第七十九条の四の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四の規定によりカレ  
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  
いては自己資本比率告示第七十九条の四第二項各号又は持株自己資本比率告示第五  
七条の四第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十九条の四  
第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第三項各号に掲げる額をそれぞ  
れ記載し、ハ欄及びニ欄については斜線を付すこと。

。 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三  
の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三の規定により期待エクスポージャー  
方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示  
第七十九条の三第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三第二  
項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の三  
第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の三第二項第一号の算式にお  
いて用いる  $\alpha$  又は自己資本比率告示第七十九条の三第四項の規定若しくは持株自己資  
本比率告示第五十七条の三第四項の規定により独自に推計した  $\alpha$  を、それぞれ記載す  
ること。

[d～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つては、当該項の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)

【表略】

(注)

。 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四  
の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四の規定により期待エクスポージャー  
方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示  
第七十九条の四第二項第二号の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四第二  
項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十九条の四  
第二項第一号若しくは持株自己資本比率告示第五十七条の四第二項第一号の算式にお  
いて用いる  $\alpha$  又は自己資本比率告示第七十九条の四第四項の規定若しくは持株自己資  
本比率告示第五十七条の四第四項の規定により独自に推計した  $\alpha$  を、それぞれ記載す  
ること。

[d～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】

(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 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の三又は持株自己資本比率告示第五十七条の三に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 略]

(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、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～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、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レンシライ、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】

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 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項又は持株自己資本比率告示第二百四十八条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十九条の四又は持株自己資本比率告示第五十七条の四に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 同左]

(第十二面)

【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～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、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レンシラ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	ハ	ニ
		リスク・アセット 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、自己資本比率告示及び特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～j] 略]

k 項番5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SA-COR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第二百五十七条第五項及び第百六

(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	ハ	ニ
		リスク・アセット 当四半 期末	前四半 期末	当四半 期末	前四半 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、自己資本比率告示及び特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～j] 同左]

k 項番5-1 「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の二（自己資本比率告示第百五十



十五条第五項において準用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二(持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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 銀行法第十四条のこの規定に基づき、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●●年金融庁告示第●●号。以下この面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。)附則第二条第一項又は第四条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十九条第二項の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条第二項の規定に基づきカレント・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「カウンタ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1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、自己資本比率告示第七十九条の四(平成●●年金融庁告示第●●号附則第二条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において読み替えて適用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の四(平成●●年金融庁告示第●●号附則第四条第一項の規定により読み替えて適用する持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三条第五項において読み替えて適用する場合を含む。)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。

七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の二(持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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「カウンタパーテイ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三(自己資本比率告示第百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。)の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の三(持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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。

<p>m 項番 6 「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の三（自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は持株自己資本比率告示第五十七條の三（持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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レボ形式の取引等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>[n～pp 略]</p> <p>【(第二面)～(第四面) 略】</p>	<p>m 項番 6 「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十九条の四（自己資本比率告示第五百五十七条第五項及び第百六十五条第五項において準用する場合を含む。）の規定又は持株自己資本比率告示第五十七條の四（持株自己資本比率告示第百三十五条第五項及び第百四十三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レボ形式の取引等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>[n～pp 同左]</p> <p>【(第二面)～(第四面) 同左】</p>
---	---

備考 表中の「」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。



【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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

[a～j 略]

k 項番5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SAA-COR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第百五十六条第五項及び第百六十四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●●年金融庁告示第●●号。以下この面及び第十四面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。）附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十三条第二項の規定に基づきカレント・エクスポート方式を用いる場合には、項番5と項番6との間に「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」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、当該項には、自己資本比率告示第七十六条（平成●●年金融庁告示第●●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第百五十六条第五項及び第百六十四条第五項において読み替えて適用する場合を含む。）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

【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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

[a～j 同左]

k 項番5-1 「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポート方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第百五十六条第五項及び第百六十四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 「カウンターパーティ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十五条（自己資本比率告示第百五十六条第五項及び第百六十四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。

額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

m 項番 6 「カウンターパーティー信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十五条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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レボ形式の取引等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。

[n～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、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。

この面においては、カウンターパーティー信用リスク、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、イヌラム開発銀行、子防接種のための国際金融フレンシナイ、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。）向けエクスポージャーに係る額

m 項番 6 「カウンターパーティー信用リスクのうち、期待エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十六条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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レボ形式の取引等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。

[n～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、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。

この面においては、カウンターパーティー信用リスク、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、イヌラム開発銀行、子防接種のための国際金融フレンシナ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。

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、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。

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。

[j～z 略]

〔(第九面)～(第十三面) 略〕

(第十四面)

(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**

[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、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。

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。

[j～z 同左]

〔(第九面)～(第十三面) 同左〕

(第十四面)

(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EP E	規制上 のエク スポー ジヤー 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、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 項番 1 「SA-C CR」の項には、自己資本比率告示第七十四条の規定により SA-C CR を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十四条第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十四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。

項番						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
	再構築 コスト	アドオ 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 $\alpha$	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>					
<u>1-2</u>	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、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 項番 1-1 「カレント・エクスポージヤー方式」の項には、自己資本比率告示第七十四条の規定によりカレント・エクスポージヤー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十四条第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十四条第三項各号に掲げる額を、それぞれ記載すること。

b 平成●●年金触字告示第●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十三条第二項の規定に基づきカレント・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、自己資本比率告示第七十六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、イ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十六条第三項各号に掲げ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。

。 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十五条の規定により期待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、ハ欄については自己資本比率告示第七十五条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十五条第二項第一号の算式において用いる $\alpha$ 又は自己資本比率告示第七十五条第四項の規定により独自に推計した $\alpha$ を、それぞれ記載すること。

[d～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つては、当該項の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、自己資本比率告示において使

b 項番 1-2 「標準方式」の項には、自己資本比率告示第七十五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、ハ欄については自己資本比率告示第七十五条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。

。 項番 2 「期待エクスポージャー方式」の項には、自己資本比率告示第七十六条の規定により期待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、ハ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項第一号の算式において用いる $\alpha$ 又は自己資本比率告示第七十六条第四項の規定により独自に推計した $\alpha$ を、それぞれ記載すること。

[d～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、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 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十五条に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 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、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～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、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ビラジアンフアラ投資銀行を含む。)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

(別紙様式第七号)

用する用語の例によるものとする。

a 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十六条に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 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、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～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、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

(別紙様式第七号)

(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
	当半期末	前半期末	当半期末	前半期末	
[略]					
4	カウンターパーティ信用リスク				
5	うち、 <u>SA-COR適用分</u>				
[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、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～j] 略]

k 項番5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SA-COR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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

(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
	当半期末	前半期末	当半期末	前半期末	
[同左]					
4	カウンターパーティ信用リスク				
5-1	うち、 <u>カレント・エクスポージャー方式適用分</u>				
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、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～j] 同左]

k 項番5-1 「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスポージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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

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●●年金融庁告示第●●号。以下この面及び第十面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。)附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十三条第二項の規定に基づきカレント・エクスボ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「カウンターパーティ信用リスクのうち、カレント・エクスボージャー方式適用分」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、当該項には、自己資本比率告示第七十六条(平成●●年金融庁告示第●●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四条第五項において読み替えて適用する場合を含む。)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 項番6「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスボージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十五条(自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四条第五項において適用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及びレボ形式の取引等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。

[n~pp 略]

【(第二面)～(第四面) 略】

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、自己資本比率告示第七十五条(自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四条第五項において適用する場合を含む。)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 項番6「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスボージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十六条(自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四条第五項において適用する場合を含む。)の規定により算出した額に派生商品取引及びレボ形式の取引等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。

[n~pp 同左]

【(第二面)～(第四面) 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、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。

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、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。

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

(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、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。

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、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。

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、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سلام開発銀行、予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。

[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	アドオ ン	実効EP E	規制上 のエク スポー ジャヤー 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 ジャヤー	リスク ・アセ ットの 額

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、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سلام開発銀行、予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。

[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	アドオ ン	実効EP E	規制上 のエク スポー ジャヤー 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 ジャヤー	リスク ・アセ ットの 額

1	SA-C			1.4		
	CR					
[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、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 項番 1 「SA-C CR」の項には、自己資本比率告示第七十四条の規定により SA-C CR を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十四条第二項及び第十七項の規定により算出する額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十四条第六項及び第十八項の規定により算出する額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

b 平成●●年金融資告示第●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十三条第二項の規定に基づきカレント・エクスポート・エクスポート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・エクスポート・エクスポート」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、自己資本比率告示第七十六条の規定によりカレント・エクスポート方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十六条第三項各号に掲げる額をそれぞれ記載し、ハ欄及び三欄については斜線を付すこと。

c 項番 2 「期待エクスポート方式」の項には、自己資本比率告示第七十五条の規

1-1	カレント					
	・エクス ポート 方式					
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、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 項番 1-1 「カレント・エクスポート方式」の項には、自己資本比率告示第七十四条の規定によりカレント・エクスポート方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十四条第二項各号に掲げる額を、ロ欄については自己資本比率告示第七十四条第三項各号に掲げる額を、それぞれ記載すること。

b 項番 1-2 「標準方式」の項には、自己資本比率告示第七十五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、ハ欄については自己資本比率告示第七十五条第一項第一号の算式において 1.4 を乗ずる前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

c 項番 2 「期待エクスポート方式」の項には、自己資本比率告示第七十六条の規

定により期待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、ハ欄については自己資本比率告示第七十五条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十五条第二項第一号の算式において用いる $a$ 又は自己資本比率告示第七十五条第四項の規定により独自に推計した $a$ を、それぞれ記載すること。

[d～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、当該項の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)

【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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

a 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十五条に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 略]

(第十二面)

【表略】

定により期待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、ハ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第七十六条第二項第一号の算式において用いる $a$ 又は自己資本比率告示第七十六条第四項の規定により独自に推計した $a$ を、それぞれ記載すること。

[d～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】

(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 項番 1 「先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計」の項には、自己資本比率告示第二百七十条の四第一項のCVAリスク相当額を算出するに当たり先進的リスク測定方式を用いるポートフォリオの合計額に係る計数を記載すること。ただし、イ欄には、自己資本比率告示第七十六条に規定する期待エクスポージャー方式を用いて算出した与信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 同左]

(第十二面)

【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、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ライ、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】

(別紙様式第九号)

(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		所要自己資本		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	当四半 期末	前四半 期末	当四半 期末	前四半 期末
【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、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ラ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】

(別紙様式第九号)

(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		所要自己資本		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	当四半 期末	前四半 期末	当四半 期末	前四半 期末
【同左】								



4	カウンターパートイ信用リスク			
5	うち、 <u>SA-CCR適用分</u>			
[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、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～j 略]

k 項番 5 「カウンターパートイ信用リスクのうち、SA-CCR適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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●●年金融庁告示第●●号。以下この面において「平成●●年金融庁告示第●●号」という。）附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第七十三条第二項の規定に基づきカレント・エクスプロ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「カウンターパートイ信用リスクのうち、カレント・エクスプロージャー方式適用分」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

4	カウンターパートイ信用リスク			
5-1	うち、 <u>カレント・エクスプロージャー方式適用分</u>			
5-2	うち、 <u>標準方式適用分</u>			
[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、自己資本比率告示において使用する用語の例によるものとする。

[a～j 同左]

k 項番 5-1 「カウンターパートイ信用リスクのうち、カレント・エクスプロージャー方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十四条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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 「カウンターパートイ信用リスクのうち、標準方式適用分」の項には、自己資本比率告示第七十五条（自己資本比率告示第五十六条第五項及び第六十四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>において、当該項には、自己資本比率告示第七十六条（平成●●年金融庁告示第●●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第五百五十六条第五項及び第百六十四条第五項において読み替え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>「n～pp 略」</p> <p>【(第二面)～(第四面) 略】</p>	<p>において、当該項には、自己資本比率告示第七十六条（平成●●年金融庁告示第●●号附則第六条第一項の規定により読み替えて適用する自己資本比率告示第五百五十六条第五項及び第百六十四条第五項において読み替え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>「n～pp 同左」</p> <p>【(第二面)～(第四面) 同左】</p>
<p>備考 表中の「」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>	