

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

改正後

改正前

(別紙様式第二号)

(別紙様式第二号)

(第一面)

(第一面)

(単位：百万円)

(単位：百万円)

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

0V1：リスク・アセットの概要						
国際様式 の該当番 号	イ		ロ		ハ	ニ
	リスク・アセット		所要自己資本		当期未	前期末
[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・エクスボ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)

(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。

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]

[a～j 同左]

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

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

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かどうかを判断するための基準等の一部を改正する件（平成三十年金融庁告示第十三号。以下この面及び第十四面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第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（平成三十年金融庁告示第十三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（平成三十年金融庁告示第十三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

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。

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條第五項及び第六十五條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三百三十五條第五項及び第四百三十三條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、予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

」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條第五項及び第六十五條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三百三十五條第五項及び第四百三十三條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 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、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。

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。

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～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ー信用リスク・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。

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～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ー信用リスク・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
<u>1</u>				1.4		・アセ
				α		ットの額
						額
[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-COR」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-COR 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第二項及び第

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
<u>1-1</u>				1.4		・アセ
				α		ットの額
						額
[同左]						
1-2 標準方式						

(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第二項各号又は持株自己資本比率告示第五十七条の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第二項各

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 平成三十年金融庁告示第十三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。

- 。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 α 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 α を、それぞれ記載すること。

[d～f 略]

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を乗する前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

- 。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 α 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 α 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 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。

[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

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 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、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アイ、欧州証券会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。) 向けエクスポートに係る額を記載すること。

[i~p 略]

【(第十七面) ~ (第三十面) 略】

(別紙様式第四号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要								
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		前中間		前中間	
	当中間	期末	当中間	期末	当中間	期末	当中間	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							
[頁を削る。]								

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アイ及び欧州証券会開発銀行を含む。) 向けエクスポートに係る額を記載すること。

[i~p 同左]

【(第十七面) ~ (第三十面) 同左】

(別紙様式第四号)

(第一面)

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要								
国際様式の該当番号	イ		ロ		ハ		ニ	
	リスク・アセット		所要自己資本		前中間		前中間	
	当中間	期末	当中間	期末	当中間	期末	当中間	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							

【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條第五項及び第百六十五條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二（持株自己資本比率告示第百三十五條第五項及び第百四十三條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に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（平成三十年金融庁告示第十三号。以下この面及び第十面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第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條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（平成三十年金融庁告示第十三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

【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百五十七條第五項及び第百六十五條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二（持株自己資本比率告示第百三十五條第五項及び第百四十三條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條第五項及び第百六十五條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條第五項及び第百四十三條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。

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(平成三十年金融庁告示第十三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四百三十三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・ウエイトを乗じた額の合計額(イ欄及びロ欄)及びこれに係る所要自己資本の額(ハ欄及びニ欄)をそれぞれ記載すること。

m 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三百三十五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レボ形式の取引等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。

[n～pp 略]

【(第二面)～(第四面) 略】

(第五面)

【表略】

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、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レボ形式の取引等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。

[n～pp 同左]

【(第二面)～(第四面) 同左】

(第五面)

【同左】

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、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。

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

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。

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

評議会開発銀行及びビブアジア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ー信用リスク・エクスポージャー額								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		再構築コスト	アトオ	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	
<u>1</u>	<u>S A - C</u> <u>CR</u>				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ー信用リスク・エクスポージャー額								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		再構築コスト	アトオ	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	
<u>1-1</u>	<u>カレント</u> <u>・エクス</u> <u>ポー</u> <u>ー</u> <u>ジヤ</u> <u>ー</u> <u>方式</u>				α			
<u>1-2</u>	<u>標準方式</u>				1.4			
[同左]								

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、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 「SAA-COR」の項には、自己資本比率告示第七十九条の規定又は持株自己資本比率告示第五十七条の規定により SAA-COR 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條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條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 平成三十年金融庁告示第十三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條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條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五十七條の四第三項各号又は持株自己資本比率告示第五十七條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條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規定又は持株自己資本比率告示第五十七條の二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條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條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條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條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。

。 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條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 α 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 α 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)

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ト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 α 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 α 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ト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、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、カリアン開発銀行、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】

(別紙様式第八号)

(第一面)

(単位：百万円)

0W1：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、アフリカ開発銀行、カリアン開発銀行、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)

0W1：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	当四半		前四半		当四半		前四半	
	期末		期末		期末		期末	
[略]								
4	カウンタースーパーイ信用リスク							
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 「カウンタースーパー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	当四半		前四半		当四半		前四半	
	期末		期末		期末		期末	
[同左]								
4	カウンタースーパーイ信用リスク							
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 「カウンタースーパーイ信用リスクのうち、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 「カウンタースーパー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

成三十年金融庁告示第十三号。以下この面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。) 附則第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(平成三十年金融庁告示第十三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(平成三十年金融庁告示第十三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三百四十三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三百四十三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。

第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三百四十三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三百四十三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>[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>	

○ 信用金庫法施行規則第三百三十二条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八号）

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

改正後

改正前

(別紙様式第四号)

(別紙様式第四号)

(第一面)

(第一面)

(単位：百万円)

(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		当期末	前期末
[略]						
4	カウンターパーティ信用リスク					
5	うち、 <u>SA-CRR適用分</u>					
[項を削る。]						
[略]						

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		当期末	前期末
[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・エクスポーチャー方式適用分</u>					
5-2	うち、 <u>標準方式適用分</u>					
[同左]						

(注)

(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]

[a～j 同左]

k 項番5 「カウンターパーティ信用リスクのうち、SA-CRR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

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・エクスポーチャー方式適用分」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

び長期決済期間取引の相手方に適用されるリスク・ウェイトを乗じた額の合計額（イ欄及びロ欄）並びにこれに係る所要自己資本の額（ハ欄及びニ欄）をそれぞれ記載すること。

1 銀行法第十四条の二の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし自己資本の充実の状況が適当かどうかを判断するための基準等の一部を改正する件（平成三十年金融庁告示第十三号。以下この面及び第十四面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第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（平成三十年金融庁告示第十三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六百六十四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七十五条（自己資本比率告示第五百五十六条第五項及び第六百六十四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]

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五百五十六条第五項及び第六百六十四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。

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七十六条（自己資本比率告示第五百五十六条第五項及び第六百六十四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]

<p>【(第二面)～(第六面) 略】 (第七面)</p> <p>【表略】 (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、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。</p> <p>【o～gg 略】 (第八面)</p> <p>【表略】 (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</p>	<p>【(第二面)～(第六面) 同左】 (第七面)</p> <p>【同左】 (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 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、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。</p> <p>【o～gg 同左】 (第八面)</p> <p>【同左】 (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</p>
--	--

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سلام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)

項番	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				
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
	再構築	アドオ	実効 EP	規制上	信用リ
	コスト	ン	E	のエク	スク削
				スポー	減手法
				ジャー	適用後
				の算定	のエク
				に使用	スポー
				される	ジャー
					リスク
					・アセ
					ットの
					額

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سلام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)

項番	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				
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ
	再構築	アドオ	実効 EP	規制上	信用リ
	コスト	ン	E	のエク	スク削
				スポー	減手法
				ジャー	適用後
				の算定	のエク
				に使用	スポー
				される	ジャー
					リスク
					・アセ
					ットの
					額

1	SA-C CR	1.4	α				
[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 平成三十年金融庁告示第十三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・エクスボージャ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・エクスボージャ方式」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・エクスボージャ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。

1-1	カレント ・エクス ボージャ 方式	1.4	α				
[同左]							
1-2	標準方式	1.4					

(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・エクスボージャ方式」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・エクスボージャ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 を乗する前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

。 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 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身信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 略]

(第十六面)

。 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 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身信相当額の合計額を記載すること。

[b～i 同左]

(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、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、カリア開発銀行、カリア開発銀行、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イ、欧州評議会開発銀行及びアジアインフラ投資銀行を含む。)向けエクスポート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)

(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		
	当半期 末	前半期 末	当半期 末	前半期 末	

【同左】

(注)

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、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、アフリカ開発銀行、カリア開発銀行、カリア開発銀行、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イ及び欧州評議会開発銀行を含む。)向けエクスポート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)

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			
<u>5</u>	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（平成三十年金融庁告示第十三号。以下この面及び第十面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第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

[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・エクスポージャー方式適用分</u>			
<u>5-2</u>	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。

ト・エクスジョ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（平成三十年金融庁告示第十三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、期待エクスジョ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】
(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ジョージャー（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。

m 項番 6 「カウンターパーティ信用リスクのうち、期待エクスジョ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)

【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ジョージャー（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>[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、<u>欧州復興開発銀行</u>、<u>米州開発銀行</u>、<u>欧州投資銀行</u>、<u>欧州投資基金</u>、<u>北欧投資銀行</u>、<u>カリブ開発銀行</u>、<u>イヌラム開発銀行</u>、<u>予防接種のための国際金融フアンシリテイ</u>、<u>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</u>。）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>、<u>アフリカ開発銀行</u>、<u>欧州復興開発銀行</u>、<u>米州開発銀行</u>、<u>欧州投資銀行</u>、<u>欧州投資基金</u>、<u>北欧投資銀行</u>、<u>カリブ開発銀行</u>、<u>イヌラム開発銀行</u>、<u>予防接種のための国際金融フアンシリテイ</u>及び<u>欧州評議会開発銀行を含む</u>。）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～h 略]</p> <p>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、<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、<u>欧州復興開発銀行</u>、<u>米州開発銀行</u>、<u>欧州投資銀行</u>、<u>欧州投資基金</u>、<u>北欧投資銀行</u>、<u>カリブ開発銀行</u>、<u>イヌラム開発銀行</u>、<u>予防接種のための国際金融フアンシリテイ</u>、<u>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</u>。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。</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～h 同左]</p> <p>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、<u>多数国間投資保証機関</u>、<u>アジア開発銀行</u>、<u>アフリカ開発銀行</u>、<u>欧州復興開発銀行</u>、<u>米州開発銀行</u>、<u>欧州投資銀行</u>、<u>欧州投資基金</u>、<u>北欧投資銀行</u>、<u>カリブ開発銀行</u>、<u>イヌラム開発銀行</u>、<u>予防接種のための国際金融フアンシリテイ</u>及び<u>欧州評議会開発銀行を含む</u>。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。</p>

[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ー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築コスト	アトオ	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	
<u>1</u>	<u>S A - 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

[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ー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		再構築コスト	アトオ	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	
<u>1-1</u>	<u>カレント</u> <u>・エクス</u> <u>ポージャ</u> <u>ー方式</u>				α		
<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 「SAA-COR」の項には、自己資本比率告示第七十四条の規定により SAA-COR 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 平成三十年金融庁告示第十三号附則第六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七十三條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條の規定によりカレント・エクスポージャー方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、イ欄については自己資本比率告示第七十六條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條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。

。 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條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條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條第二項第一号の算式において用いる α 又は自己資本比率告示第七十五條第四項の規定により独自に推計した α 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

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七十四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條の規定により標準方式を用いて算出した額を記載すること。ただし、ハ欄については自己資本比率告示第七十五條第一項第一号の算式において 1.4 を乗する前の額を、三欄については「1.4」を、それぞれ記載すること。

。 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條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條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條第二項第一号の算式において用いる α 又は自己資本比率告示第七十六條第四項の規定により独自に推計した α 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。

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】

(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、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、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ナシリテイ、欧州評

[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 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、アフリカ開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、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ナシリテイ及欧州評議会開発銀行

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)

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		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】								
4	カウンタパーティ信用リスク							
<u>5</u>	うち、SA-CCR適用分							
【頁を削る。】								
【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

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)

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		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	カウンタパーティ信用リスク							
<u>5-1</u>	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分							
<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、S.A.C.C.R.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（平成三十年金融庁告示第十三号。以下この面において「平成三十年金融庁告示第十三号」という。）附則第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 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（平成三十年金融庁告示第十三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七十五条（自己資本比率告示第五十六条第五項及

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七十六条（自己資本比率告示第五十六条第五項及

<p>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]</p>	<p>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]</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>	<p>【(第二面)～(第四面) 略】</p> <p>【(第二面)～(第四面) 同左】</p>