b　ハ欄には、引当金（一般貸倒引当金を除く。）の控除後かつ連結自己資本規制比率告示に基づき信用リスク・アセットの額の算出に用いられている償却額の償却後のオン・バランス資産項目のエクスポージャーの額を記載すること。

c　ニ欄には、ＣＣＦ（連結自己資本規制比率告示に基づき信用供与枠の未引出額又はオフ・バランス資産項目に係る想定元本額に対して適用される掛目をいう。以下この面において同じ。）を適用する前のオフ・バランス資産項目のエクスポージャーの額（ＣＣＦを適用する対象となる信用供与枠の未引出額又はその他のオフ・バランス資産項目に係る想定元本額）を記載すること。また、当該額は信用リスク削減手法（連結自己資本規制比率告示第五十六条第一項に規定する信用リスク削減手法をいう。以下この面において同じ。）の効果を勘案する前の額とすること。

d　ホ欄のうち、「マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー」の「内部モデル手法」の項においては、リスク・ウェイトをＣＣＦ適用後かつ信用リスク削減手法の効果を勘案した後のＥＡＤにより加重平均した値を記載すること。

e　ヘ欄からヌ欄までには、ＣＣＦ適用後かつ信用リスク削減手法の効果の勘案後のエクスポージャーの額（ＥＡＤ）を記載すること。ヘ欄にはプロジェクト・ファイナンス、ト欄にはオブジェクト・ファイナンス、チ欄にはコモディティ・ファイナンス、リ欄には事業用不動産向け貸付けに係る額をそれぞれ記載すること。

f　「ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（ＨＶＣＲＥ）以外」の「合計」の項ル欄の額及び「ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（ＨＶＣＲＥ）」の「合計」の項ル欄の額並びに第九面の「合計（全てのポートフォリオ）」の項リ欄の額の合計額は、第一面の項番３「信用リスク　うち、内部格付手法適用分」の項イ欄の額と一致する。

g　「マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー」の「合計」の項ル欄の額及び「100％のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー」の項ル欄の額の合計額は、第一面の項番７「マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー」の項イ欄の額と一致する。

h　この面に定める各項目につき、自金融機関で該当する額等がない場合には項を削除せず、「―」を記載すること。

i　この面に記載する額は、この面で指定された単位で記載し、当該単位未満の端数は切り捨てること。

j　この面に記載する比率は、小数点以下二位未満の端数があるときは、これを切り捨てること。

k　この面は、自金融機関が標準的手法を採用した場合にあっては、作成することを要しない。

（第十四面）

（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ＥＰＥ	上記ニ欄の規制エクスポージャ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ー	リスク・アセットの額
１―１	カレント・エクスポージャー方式						
１―２	標準方式				1.4		
２	期待エクスポージャー方式						
３	信用リスク削減手法における簡便手法						
４	信用リスク削減手法における包括的手法						
５	エクスポージャー変動推計モデル						
６	合計						

（注）

この面において使用する用語は、特段の定めがない限り、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―１「カレント・エクスポージャー方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十七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、イ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条第一項第一号に掲げる額及び同条第二項に規定する額を、ロ欄については連結自己資本規制比率告示第四十七条第一項第二号に掲げる額及び同条第三項に規定する額を、それぞれ記載すること。

b　項番１―２「標準方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十八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、ハ欄については連結自己資本規制比率告示第四十八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。

c　項番２「期待エクスポージャー方式」の項には、連結自己資本規制比率告示第四十九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、ハ欄については連結自己資本規制比率告示第四十九条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については連結自己資本規制比率告示第四十九条第二項第一号の算式において用いるα又は連結自己資本規制比率告示第四十九条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　項番３「信用リスク削減手法における簡便手法」の項には、連結自己資本規制比率告示第三章第六節第四款に定める簡便手法により算出した額を記載すること。

e　項番４「信用リスク削減手法における包括的手法」の項には、連結自己資本規制比率告示第三章第六節第三款に定める包括的手法（ただし、同款第七目の規定により算出する額を除く。）により算出した額を記載すること。