f　項番５「エクスポージャー変動推計モデル」の項には、連結自己資本規制比率告示第八十五条の規定により算出した額を記載すること。

g　項番６「合計」の項ヘ欄には、項番１－１から項番５までの項ヘ欄の合計額を記載すること。

h　ホ欄には、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の効果を勘案した後のエクスポージャーの額を記載すること。ただし、内部格付手法を採用した場合にあっては、連結自己資本規制比率告示第百三十四条第二項第一号に規定する法的に有効な相対ネッティング契約（レポ形式の取引に限る。）に限り、信用リスク削減手法の効果を勘案した後のＥＡＤを記入すること。また、連結自己資本規制比率告示第四十六条第六項（連結自己資本規制比率告示第百三十四条第五項及び第百四十二条第五項において準用する場合を含む。）の規定によりＣＶＡの影響を勘案している場合には、勘案後の金額を記載すること。

i　項番６「合計」の項ヘ欄の額、第十五面の項番５「ＣＶＡリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計」の項ロ欄の額並びに第二十一面の項番１「適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額及び項番11「非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額の合計額は、第一面の項番４「カウンターパーティ信用リスク」の項イ欄の額と一致する。

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

k　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。

（第十五面）
（単位：百万円）

ＣＣＲ２：ＣＶＡリスクに対する資本賦課

項番		イ	ロ
		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（ＣＶＡリスク相当額を８％で除して得た額）
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		
2	(i)ＣＶＡバリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）		
3	(ii)ＣＶＡストレス・バリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）		
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計		
5	ＣＶＡリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計		

(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「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、連結自己資本規制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、連結自己資本規制比率告示第四十九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　項番２「(i)ＣＶＡバリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）」の項には、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の四第一項第一号に規定するＣＶＡバリュー・アット・リスクに３を乗じ８パーセントで除して得た額を記載すること。

c　項番３「(ii)ＣＶＡストレス・バリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）」の項には、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の四第一項第二号に規定するＣＶＡストレス・バリュー・アット・リスクに３を乗じ８パーセントで除して得た額を記載すること。

d　項番４「標準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、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の三のＣＶＡリスク相当額を算出するに当たり標準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、連結自己資本規制比率告示第二百四十八条の三第一項の算式中の与信相当額（ＥＡＤ）の合計額を記載すること。

e　項番５「ＣＶＡリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計」の項には、項番１の項に記載された額及び項番４の項に記載された額の合計額を記載すること。

f　ロ欄には、各計測手法に基づき算出されたＣＶＡリスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

g　項番５「ＣＶＡリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計」の項ロ欄の額、第十四面の項番６「合計」の項ヘ欄の額並びに第二十一面の項番１「適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額及び項番11「非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）」の項ロ欄の額の合計額は、第一面の項番４「カウンターパーティ信用リスク」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。

（第十六面）
（単位：百万円）

ＣＣＲ３：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

項番	リスク・ウェイト／業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額（信用リスク削減効果勘案後）								
		０％	10％	20％	50％	75％	100％	150％	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け									
2	外国の中央政府及び中央銀行向け									
3	国際決済銀行等向け									
4	我が国の地方公共団体向け									