第明治三十種郵便物認可

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	上記ニの規制エクスポージャー算定に使用される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。

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、第十一面の項番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十六面の項番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。

（第十一面）

（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		