k　ヘ欄には、ＲＷＡ計算基準日時点における債務者の数を記載すること。概数を記載する場合には、その記載方針についても併せて説明すること。リテール向けエクスポージャーのポートフォリオについては、ＰＤ推計にデフォルトした債権の数を用いている場合、債務者の数に代えて債権の数で開示することができる（債権の数で開示する場合には説明を付すこと。）。

l　ト欄には、ＬＧＤの値を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。ＬＧＤは、信用リスク削減手法の効果を勘案した後のＬＧＤとする。

m　チ欄には、自己資本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取引のマチュリティを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。当該欄は、ＲＷＡ計算においてマチュリティ情報が使用される場合にのみ記載すること。

n　b(6)のポートフォリオ区分を記載する場合において、リ欄には、自己資本比率告示第百四十八条第九項の規定により算出した信用リスク・アセットの額に、ル欄の額に1250パーセントを乗じた額を加算した額を記載すること。

o　ヌ欄には、リ欄の額をニ欄の額で除して得た値を記載すること。

p　ル欄には、自己資本比率告示第百三十一条の規定により算出された期待損失額を記載すること。

q　ヲ欄には、適格引当金の額を記載すること（ＰＤ/ＬＧＤ方式が適用される株式等エクスポージャーについては、斜線を付すこと。）。

r　「合計（全てのポートフォリオ）」の項リ欄の額並びに第十三面の「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。

s　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。

t　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。

u　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。

v　この面に記載する件数及び期間は、この面で指定された単位で記載し、小数点以下一位未満の端数があるときは、これを切り捨てること。

w　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）

ＣＲ７：内部格付手法ー信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ勘案前の信用リスク・アセットの額	実際の信用リスク・アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャーーＦＩＲＢ		
2	ソブリン向けエクスポージャーーＡＩＲＢ		
3	金融機関等向けエクスポージャーーＦＩＲＢ		
4	金融機関等向けエクスポージャーーＡＩＲＢ		
5	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）ーＦＩＲＢ		
6	事業法人向けエクスポージャー（特定貸付債権を除く。）ーＡＩＲＢ		
7	特定貸付債権ーＦＩＲＢ		
8	特定貸付債権ーＡＩＲＢ		
9	リテールー適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー		
10	リテールー居住用不動産向けエクスポージャー		
11	リテールーその他リテール向けエクスポージャー		
12	株式ーＦＩＲＢ		
13	株式ーＡＩＲＢ		
14	購入債権ーＦＩＲＢ		
15	購入債権ーＡＩＲＢ		
16	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、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信用リスク・アセットのみなし計算（自己資本比率告示第百四十九条の規定により信用リスク・アセットの額を計算することをいう。）に係る信用リスクは対象外とする。

a　この面においては、自己資本比率規制上の連結の範囲に含まれ、かつ内部格付手法において認識される計数を記載すること（標準的手法を適用するポートフォリオについては、この面における開示の対象外とする。）。

b　ポートフォリオごとに計数を記載すること。項番１から項番８まで及び項番12から項番15までについては、適用手法（基礎的内部格付手法（ＦＩＲＢ）及び先進的内部格付手法（ＡＩＲＢ））別に計数を記載すること。