（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	規制上クーの使用されるスジャーの算定にエポー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、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五十七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、イ欄については自己資本比率告示第五十七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五十七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五十八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、ハ欄については自己資本比率告示第五十八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、自己資本比率告示第五十九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、ハ欄については自己資本比率告示第五十九条第二項第二号の規定により算出した額を、ニ欄については自己資本比率告示第五十九条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五十九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、自己資本比率告示第四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、自己資本比率告示第四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、自己資本比率告示第九十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、自己資本比率告示第六十一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、自己資本比率告示第百三十九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、自己資本比率告示第五十六条第六項（自己資本比率告示第百三十九条第五項及び第百四十七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、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二百五十三条の四第一項の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五十九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。

第明治三十五種郵便物認可　平成二十九年三月三十一日