（第八面）
（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。

c　イ欄には、信用リスク削減手法（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をいう。以下この面において同じ。）としてクレジット・デリバティブを利用しないと仮定した場合（信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブを現に利用していない場合を含む。）の信用リスク・アセットの額の合計額を記載すること。

d　ロ欄には、信用リスク削減手法の効果を勘案した後の信用リスク・アセットの額の合計額を記載すること。

e　必要に応じて、クレジット・デリバティブに係る信用リスク削減手法の効果について説明を付すこと。

f　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、「ー」を記載すること。

g　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。

h　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。

（第九面）
（単位：百万円、％）

ＣＲ10：内部格付手法ー特定貸付債権（スロッティング・クライテリア方式）と株式等エクスポージャー（マーケット・ベース方式等）

イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権（スロッティング・クライテリア方式）											
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け（ＨＶＣＲＥ）以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	エクスポージャーの額（ＥＡＤ）					信用リスク・アセットの額	期待損失
					ＰＦ	ＯＦ	ＣＦ	ＩＰＲＥ	合計		
優（Strong）	2.5年未満			50％							
	2.5年以上			70％							