2	0.15以上0.25未満							
3	0.25以上0.50未満							
4	0.50以上0.75未満							
5	0.75以上2.50未満							
6	2.50以上10.00未満							
7	10.00以上100.00未満							
8	100.00（デフォルト）							
9	小計							
	金融機関等向けエクスポージャー							
	（略）							
…								
	（略）							
合計（全てのポートフォリオ）								

(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から項番８までのＰＤの範囲に応じて、リスク・アセットの計算に使用するＰＤを基に、取引相手方のエクスポージャーごとに、それぞれの計数を集計すること。

b　内部格付手法が適用されるポートフォリオごとに区分して計数を記載すること（どのポートフォリオに係る計数を記載しているかが明らかになるよう、適宜項を追加し、ポートフォリオの名称を記載すること。）。ただし、ポートフォリオ区分には、少なくとも⑴ソブリン向けエクスポージャー、⑵金融機関等向けエクスポージャー及び⑶事業法人向けエクスポージャーを含むものとする。

c　先進的内部格付手法を採用した場合にあっては、基礎的内部格付手法と先進的内部格付手法の双方を利用しているときは、それぞれ面を分けて作成すること。

d　イ欄には、自己資本比率告示第四章第六節に定める信用リスク削減手法の効果を勘案した後のＥＡＤの額を記載すること。

e　ロ欄には、ＰＤの値をイ欄の額により加重平均した値を記載すること。

f　ハ欄には、該当するＰＤの範囲にある取引相手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。

g　ニ欄には、ＬＧＤの値をイ欄の額により加重平均した値を記載すること。

h　ホ欄には、自己資本比率告示の規定により信用リスク・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イ欄の額により加重平均した値を記載すること。

i　ヘ欄には、内部格付手法により算出した信用リスク・アセットの額を記載すること。

j　ト欄には、ヘ欄の額をイ欄の額で除して得た値を記載すること。

k　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。

l　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。

m　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。

n　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。

o　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。

（第十四面）

（単位：百万円）

ＣＣＲ５：担保の内訳

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金（国内通貨）						
2	現金（外国通貨）						
3	国内ソブリン債						
4	その他ソブリン債						
5	政府関係機関債						
6	社債						
7	株式						
8	その他担保						
9	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　この面においては、自金融機関が行う派生商品取引又はレポ形式の取引において使用される担保の額につき、自己資本比率告示第四章第六節第三款第二目に定める標準的ボラティリティ調整率（エクスポージャーと担保の通貨が異なる場合に適用するボラティリティ調整率を除く。）を勘案した後の額を記載すること（イ欄、ロ欄及びホ欄にはボラティリティ調整率を控除した後の額を、ハ欄、ニ欄及びヘ欄にはボラティリティ調整率を加算した後の額をそれぞれ記載すること。）。