(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二百四十七条の四第一項の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五十六条の四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。

b　項番２「(i)ＣＶＡバリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）」の項には、自己資本比率告示第二百四十七条の四第一項第一号に規定するＣＶＡバリュー・アット・リスクに３を乗じ８パーセントで除して得た額を記載すること。

c　項番３「(ii)ＣＶＡストレス・バリュー・アット・リスクの額（乗数適用後）」の項には、自己資本比率告示第二百四十七条の四第一項第二号に規定するＣＶＡストレス・バリュー・アット・リスクに３を乗じ８パーセントで除して得た額を記載すること。

d　項番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」の項には、自己資本比率告示第二百四十七条の三のＣＶＡリスク相当額を算出するに当たり標準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二百四十七条の三第一項の算式中の与信相当額（ＥＡＤ）の合計額を記載すること。

e　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」の項には、項番１の項に記載された額及び項番４の項に記載された額の合計額を記載すること。

f　ロ欄には、各計測手法に基づき算出されたＣＶＡリスク相当額を８パーセントで除して得た額を記載すること。

g　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、第十面の項番６「合計」の項へ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。

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。

（第十二面）

（単位：百万円）

ＣＣＲ３：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

項番	業種＼リスク・ウェイト	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ
		与信相当額（信用リスク削減効果勘案後）								
		０％	10％	20％	50％	75％	100％	150％	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け									
2	外国の中央政府及び中央銀行向け									
3	国際決済銀行等向け									
4	我が国の地方公共団体向け									
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け									
6	国際開発銀行向け									
7	地方公共団体金融機構向け									
8	我が国の政府関係機関向け									
9	地方三公社向け									
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け									
11	法人等向け									
12	中小企業等向け及び個人向け									
13	上記以外									
14	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　イ欄からリ欄までには、自己資本比率告示第四章第五節に定める信用リスク削減手法の効果を勘案した後の与信相当額を記入すること。

b　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百二十三条又は第百二十五条の規定により標準的手法を適用する事業単位又は資産区分があるときは、当該事業単位又は資産区分に係る計数を記載すること。ただし、当該事業単位又は資産区分に係る開示情報が利用者にとって重要でないと考えられる場合には、記載を省略することができる（当該記載を省略した場合においては、当該事業単位又は資産区分に係る開示情報が利用者にとって重要でないと考えられる理由を、当該事業単位又は資産区分に係るエクスポージャーの内容の説明及び当該エクスポージャーの信用リスク・アセットの額の合計額と併せて記載するものとする。）。

c　項番１「日本国政府及び日本銀行向け」の項には、日本国政府及び日本銀行向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

d　項番２「外国の中央政府及び中央銀行向け」の項には、外国の中央政府及び中央銀行向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

e　項番３「国際決済銀行等向け」の項には、国際決済銀行、国際通貨基金、欧州中央銀行、欧州共同体、欧州安定メカニズム及び欧州金融安定ファシリティ向けエクスポージャーに係る額を記載すること。