f　項番４「我が国の地方公共団体向け」の項には、我が国の地方公共団体向けエクスポージャー（特定の事業からの収入のみをもって返済されることとなっているものを除く。）に係る額を記載すること。

g　項番５「外国の中央政府等以外の公共部門向け」の項には、外国の中央政府及び中央銀行以外の公共部門（当該国による公共部門の定義によるものとする。）向けエクスポージャー（特定の事業からの収入のみをもって返済されることとなっているものを除く。）に係る額を記載すること。

h　項番６「国際開発銀行向け」の項には、国際開発銀行（国際復興開発銀行、国際金融公社、多数国間投資保証機関、アジア開発銀行、アフリカ開発銀行、欧州復興開発銀行、米州開発銀行、欧州投資銀行、欧州投資基金、北欧投資銀行、カリブ開発銀行、イスラム開発銀行、予防接種のための国際金融ファシリティ及び欧州評議会開発銀行を含む。）向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

i　項番７「地方公共団体金融機構向け」の項には、地方公共団体金融機構向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

j　項番８「我が国の政府関係機関向け」の項には、自己資本比率告示第三十八条第一項各号に掲げる法人向けのエクスポージャーに係る額を記載すること。

k　項番９「地方三公社向け」の項には、土地開発公社、地方住宅供給公社及び地方道路公社向けのエクスポージャーに係る額を記載すること。

l　項番10「金融機関及び第一種金融商品取引業者向け」の項には、金融機関（自己資本比率告示第一条第六号ロに掲げる者を除く。）、外国銀行、銀行持株会社及び銀行持株会社に準ずる外国の会社並びに第一種金融商品取引業者向けのエクスポージャーに係る額を記載すること。

m　項番11「法人等向け」の項には、自己資本比率告示第四十二条第一項に規定する法人等向けエクスポージャーに係る額を記載すること。ただし、項番12に該当するものは含まないものとする。

n　項番12「中小企業等向け及び個人向け」の項には、75パーセントのリスク・ウェイトが適用される中小企業等（自己資本比率告示第四十五条第三項各号に掲げるものをいう。）向けエクスポージャー及び個人向けエクスポージャーに係る額を記載すること。

o　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。

p　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。

（第十三面）

（単位：百万円、％、千件、年）

ＣＣＲ４：内部格付手法―ポートフォリオ別及びＰＤ区分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	ＰＤ区分	イ ＥＡＤ（信用リスク削減効果勘案後）	ロ 平均ＰＤ	ハ 取引相手方の数	ニ 平均ＬＧＤ	ホ 平均残存期間	ヘ 信用リスク・アセット	ト リスク・ウェイトの加重平均値（RWA density）
	ソブリン向けエクスポージャー							
1	0.00以上0.15未満							
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。