

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【ちゅうぎんフィナンシャルグループ連結：2023年3月末】

(別紙様式第八号第一面)

(単位：百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年 3月末	2022年 12月末	2023年 3月末	2022年 12月末
1	信用リスク	2,818,096	2,782,352	238,565	235,530
2	うち、標準的手法適用分	36,753	35,691	2,940	2,855
3	うち、内部格付手法適用分	2,732,906	2,696,299	231,750	228,646
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	48,436	50,360	3,874	4,028
4	カウンターパーティ信用リスク	88,380	88,110	7,212	7,201
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	25,912	29,187	2,197	2,475
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,237	51,248	3,779	4,099
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,520	4,966	921	397
	その他	3,708	2,708	314	229
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	361,227	365,296	30,632	30,977
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	307,084	314,718	26,040	26,687
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	240	235	19	18
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	124,069	121,831	9,925	9,746
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	124,069	121,831	9,925	9,746
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	163,294	161,147	13,063	12,891
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	163,294	161,147	13,063	12,891
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	51,883	60,628	4,395	5,136
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	3,914,277	3,894,321	329,854	328,190

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【ちゅうぎんフィナンシャルグループ連結:2023年3月末】

(別紙様式第八号第二面)

(単位:百万円)

CR8: 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,154,872	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	21,608
3		ポートフォリオの質	2,103
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,178,584	

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【中国銀行連結:2023年3月末】

(別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	2,776,221	2,742,347	235,242	232,363
2	うち、標準的手法適用分	9	9	0	0
3	うち、内部格付手法適用分	2,738,571	2,703,184	232,230	229,230
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	37,640	39,153	3,011	3,132
4	カウンターパーティ信用リスク	88,399	88,132	7,214	7,203
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	25,926	29,203	2,198	2,476
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,242	51,254	3,779	4,100
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,520	4,966	921	397
	その他	3,708	2,708	314	229
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	373,545	374,560	31,676	31,762
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	306,942	314,616	26,028	26,679
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	-	-	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	124,069	121,831	9,925	9,746
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	124,069	121,831	9,925	9,746
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	156,559	154,399	12,524	12,351
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	156,559	154,399	12,524	12,351
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	42,173	52,882	3,575	4,483
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	3,867,911	3,848,770	326,188	324,591

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【中国銀行連結：2023年3月末】

(別紙様式第八号第二面)

(単位：百万円)

CR8: 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,164,214	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	21,295
3		ポートフォリオの質	2,170
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,187,679	

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【中国銀行単体：2023年3月末】

(別紙様式第八号第一面)

(単位：百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年 3月末	2022年 12月末	2023年 3月末	2022年 12月末
1	信用リスク	2,775,119	2,741,531	235,150	232,294
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,737,652	2,702,523	232,152	229,174
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	37,467	39,007	2,997	3,120
4	カウンターパーティ信用リスク	88,399	88,132	7,214	7,203
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	25,926	29,203	2,198	2,476
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,242	51,254	3,779	4,100
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,520	4,966	921	397
	その他	3,708	2,708	314	229
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	373,545	374,560	31,676	31,762
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	305,935	313,675	25,943	26,599
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	-	-	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	124,069	121,831	9,925	9,746
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	124,069	121,831	9,925	9,746
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	154,072	151,943	12,325	12,155
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	154,072	151,943	12,325	12,155
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	36,073	48,600	3,059	4,121
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	3,857,216	3,840,276	325,294	323,884