

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:2022年12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	
		2022年 12月末	2022年 9月末	2022年 12月末	2022年 9月末
1	信用リスク	2,782,352		235,530	
2	うち、標準的手法適用分	35,691		2,855	
3	うち、内部格付手法適用分	2,696,299		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	50,360		4,028	
4	カウンターパーティ信用リスク	88,110		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	29,187		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	51,248		4,099	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,966		397	
	その他	2,708		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	365,296		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)	314,718		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%)	235		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	121,831		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	121,831		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	161,147		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	161,147		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	60,628		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	3,894,321		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

【中国銀行連結:2022年12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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	2,742,347	2,740,978	232,363	232,047
2	うち、標準的手法適用分	9	35,408	0	2,832
3	うち、内部格付手法適用分	2,703,184	2,660,205	229,230	225,585
	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	39,153	45,364	3,132	3,629
4	カウンターパーティ信用リスク	88,132	73,668	7,203	6,017
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	29,203	22,814	2,476	1,934
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	51,254	45,327	4,100	3,626
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,966	2,419	397	193
	その他	2,708	3,106	229	263
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	374,560	377,239	31,762	31,989
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)	314,616	285,071	26,679	24,174
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%)	-	241	-	19
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	121,831	131,700	9,746	10,536
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	121,831	131,700	9,746	10,536
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	154,399	161,147	12,351	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	154,399	161,147	12,351	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	52,882	50,675	4,483	4,292
	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	3,848,770	3,820,723	324,591	321,968

## 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：2022年12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	3,121,151
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		ポートフォリオの質
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	3,164,214

(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：2022年12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	
		2022年 12月末	2022年 9月末	2022年 12月末	2022年 9月末
1	信用リスク	2,741,531	2,720,208	232,294	230,489
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,702,523	2,681,892	229,174	227,424
	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	39,007	38,316	3,120	3,065
4	カウンターパーティ信用リスク	88,132	73,710	7,203	6,021
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	29,203	22,842	2,476	1,937
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	51,254	45,342	4,100	3,627
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,966	2,419	397	193
	その他	2,708	3,106	229	263
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	374,560	377,199	31,762	31,986
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)	313,675	284,139	26,599	24,095
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	121,831	131,700	9,746	10,536
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	121,831	131,700	9,746	10,536
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	151,943	151,943	12,155	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	151,943	151,943	12,155	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	48,600	44,162	4,121	3,744
	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	3,840,276	3,783,064	323,884	319,029