

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6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 6月末	2023年 3月末	2023年 6月末	2023年 3月末
1	信用リスク	2,876,459	2,818,096	243,510	238,565
2	うち、標準的手法適用分	36,782	36,753	2,942	2,940
3	うち、内部格付手法適用分	2,790,314	2,732,906	236,618	231,750
	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	49,362	48,436	3,949	3,874
4	カウンターパーティ信用リスク	91,586	88,380	7,480	7,212
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	24,721	25,912	2,096	2,197
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	48,144	47,237	3,851	3,779
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,506	11,520	920	921
	その他	7,213	3,708	611	314
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	412,696	361,227	34,996	30,632
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)	320,260	307,084	27,157	26,040
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%)	249	240	19	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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	163,294	13,063	13,063
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	163,294	13,063	13,063
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	36,919	51,883	3,126	4,395
	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	4,033,683	3,914,277	339,931	329,854

## 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6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	3,178,584
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模 96,989
3		ポートフォリオの質 Δ 3,370
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	3,272,204

(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6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6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	2,836,433	2,776,221	240,347	235,242
2	うち、標準的手法適用分	10	9	0	0
3	うち、内部格付手法適用分	2,798,458	2,738,571	237,309	232,230
	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	37,963	37,640	3,037	3,011
4	カウンターパーティ信用リスク	91,622	88,399	7,483	7,214
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	24,748	25,926	2,098	2,198
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	48,153	47,242	3,852	3,779
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,506	11,520	920	921
	その他	7,213	3,708	611	314
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	425,398	373,545	36,073	31,676
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)	320,114	306,942	27,145	26,028
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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	156,559	12,524	12,524
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	156,559	12,524	12,524
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	27,018	42,173	2,290	3,575
	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	3,989,363	3,867,911	336,442	326,188

## 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6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	3,187,679
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模 97,841
3		ポートフォリオの質 Δ 1,586
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	3,283,934

(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6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 6月末	2023年 3月末	2023年 6月末	2023年 3月末
1	信用リスク	2,835,300	2,775,119	240,252	235,150
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,797,510	2,737,652	237,228	232,152
	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	37,789	37,467	3,023	2,997
4	カウンターパーティ信用リスク	91,622	88,399	7,483	7,214
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	24,748	25,926	2,098	2,198
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	48,153	47,242	3,852	3,779
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	11,506	11,520	920	921
	その他	7,213	3,708	611	314
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	425,398	373,545	36,073	31,676
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)	318,910	305,935	27,043	25,943
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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	132,217	124,069	10,577	9,925
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	154,072	12,325	12,325
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	154,072	12,325	12,325
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	21,299	36,073	1,806	3,059
	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	3,978,820	3,857,216	335,562	325,294