

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9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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,967,125	2,876,459	251,208	243,510
2	うち、標準的手法適用分	38,519	36,782	3,081	2,942
3	うち、内部格付手法適用分	2,883,075	2,790,314	244,484	236,618
	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	45,531	49,362	3,642	3,949
4	カウンターパーティ信用リスク	105,066	91,586	8,572	7,480
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	27,622	24,721	2,342	2,096
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	57,132	48,144	4,570	3,851
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,200	11,506	1,056	920
	その他	7,111	7,213	603	611
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	444,680	412,696	37,708	34,996
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)	342,087	320,260	29,007	27,157
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%)	245	249	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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	165,525	163,294	13,242	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	165,525	163,294	13,242	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	43,327	36,919	3,669	3,126
	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	4,203,311	4,033,683	354,249	339,931

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9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	3,272,204
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	3,403,204

(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9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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,928,851	2,836,433	248,188	240,347
2	うち、標準的手法適用分	12	10	0	0
3	うち、内部格付手法適用分	2,891,778	2,798,458	245,222	237,309
	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	37,060	37,963	2,964	3,037
4	カウンターパーティ信用リスク	105,111	91,622	8,575	7,483
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	27,656	24,748	2,345	2,098
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	57,143	48,153	4,571	3,852
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,200	11,506	1,056	920
	その他	7,111	7,213	603	611
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	444,640	425,398	37,705	36,073
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)	341,767	320,114	28,981	27,145
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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	158,354	156,559	12,668	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	158,354	156,559	12,668	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	41,476	27,018	3,516	2,290
	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	4,155,454	3,989,363	350,456	336,442

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9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	3,283,934
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		47,987
4		ポートフォリオの質
5		78,880
6		モデルの更新
7		-
8		-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,410,802

(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9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 9月末	2023年 6月末	2023年 9月末	2023年 6月末
1	信用リスク	2,927,730	2,835,300	248,093	240,252
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,890,705	2,797,510	245,131	237,228
	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	37,025	37,789	2,962	3,023
4	カウンターパーティ信用リスク	105,111	91,622	8,575	7,483
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	27,656	24,748	2,345	2,098
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	57,143	48,153	4,571	3,852
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	13,200	11,506	1,056	920
	その他	7,111	7,213	603	611
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	444,640	425,398	37,705	36,073
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)	340,608	318,910	28,883	27,043
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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	135,253	132,217	10,820	10,577
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	155,652	154,072	12,452	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	155,652	154,072	12,452	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	34,177	21,299	2,898	1,806
	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	4,143,174	3,978,820	349,429	335,562