

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	
		2023年 12月末	2023年 9月末	2023年 12月末	2023年 9月末
1	信用リスク	2,945,520	2,967,125	249,368	251,208
2	うち、標準的手法適用分	40,020	38,519	3,201	3,081
3	うち、内部格付手法適用分	2,859,773	2,883,075	242,508	244,484
	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	45,726	45,531	3,658	3,642
4	カウンターパーティ信用リスク	92,989	105,066	7,597	8,572
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	26,473	27,622	2,244	2,342
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,699	57,132	3,815	4,570
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,384	13,200	990	1,056
	その他	6,432	7,111	545	603
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	422,701	444,680	35,845	37,708
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)	345,814	342,087	29,323	29,007
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%)	251	245	20	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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	165,525	13,242	13,242
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	165,525	13,242	13,242
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	29,786	43,327	2,521	3,669
	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	4,140,070	4,203,311	348,916	354,249

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	3,403,204
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		△ 20,295
4		ポートフォリオの質
5		△ 38,578
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	3,344,330

(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	
		2023年 12月末	2023年 9月末	2023年 12月末	2023年 9月末
1	信用リスク	2,907,611	2,928,851	246,378	248,188
2	うち、標準的手法適用分	15	12	1	0
3	うち、内部格付手法適用分	2,868,726	2,891,778	243,267	245,222
	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	38,870	37,060	3,109	2,964
4	カウンターパーティ信用リスク	93,013	105,111	7,599	8,575
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	26,491	27,656	2,246	2,345
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,704	57,143	3,816	4,571
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,384	13,200	990	1,056
	その他	6,432	7,111	545	603
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	422,661	444,640	35,841	37,705
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)	345,515	341,767	29,299	28,981
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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	158,354	12,668	12,668
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	158,354	12,668	12,668
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	27,988	41,476	2,372	3,516
	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	4,092,624	4,155,454	345,158	350,456

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	3,410,802
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		△ 20,255
4		ポートフォリオの質
5		△ 38,346
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	3,352,200

(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	
		2023年 12月末	2023年 9月末	2023年 12月末	2023年 9月末
1	信用リスク	2,906,381	2,927,730	246,274	248,093
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,867,545	2,890,705	243,167	245,131
	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	38,835	37,025	3,106	2,962
4	カウンターパーティ信用リスク	93,013	105,111	7,599	8,575
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	26,491	27,656	2,246	2,345
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,704	57,143	3,816	4,571
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	12,384	13,200	990	1,056
	その他	6,432	7,111	545	603
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	422,661	444,640	35,841	37,705
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)	344,282	340,608	29,195	28,883
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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	137,480	135,253	10,998	10,820
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	155,652	12,452	12,452
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	155,652	12,452	12,452
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	22,903	34,177	1,942	2,898
	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	4,082,374	4,143,174	344,303	349,429