

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：2024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	
		2024年 6月末	2024年 3月末	2024年 6月末	2024年 3月末
1	信用リスク	3,563,299	3,485,196	285,063	278,815
2	うち、標準的手法適用分	726,960	695,407	58,156	55,632
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,497,386	2,472,507	199,790	197,800
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	295,040	273,628	23,603	21,890
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	43,912	43,652	3,512	3,492
6	カウンターパーティ信用リスク	22,346	24,231	1,787	1,938
7	うち、SA-CCR適用分	11,324	11,472	905	917
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,155	1,148	92	91
9	その他	9,865	11,610	789	928
10	CVAリスク	19,398	23,365	1,551	1,869
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	19,398	23,365	1,551	1,869
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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)	288,957	279,456	23,116	22,356
13	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%)	-	-	-	-
14	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%)	-	-	-	-
15	未決済取引	-	-	-	-
16	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	147,131	148,961	11,770	11,916
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	147,131	148,961	11,770	11,916
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	149,536	149,536	11,962	11,962
25	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	27,241	11,738	2,179	939
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,217,911	4,122,486	337,432	329,798

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:2024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	2,790,030	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	58,713
3		ポートフォリオの質	2,889
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	2,851,633	

(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

【ちゅうぎんフィナンシャルグループ連結：2024年6月末】

(別紙様式第八号第六面)

(単位：百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	信用リスク	2,792,426	726,960	3,519,387	5,307,828
2	カウンターパーティ信用リスク	21,190	1,155	22,346	29,722
3	CVAリスク		19,398	19,398	24,956
4	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	-	147,131	147,131	147,131
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		149,536	149,536	149,536
7	その他リスク・アセット		360,110	360,110	353,923
8	合計	2,813,617	1,404,293	4,217,911	6,013,098

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：2024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	
		2024年 6月末	2024年 3月末	2024年 6月末	2024年 3月末
1	信用リスク	3,508,040	3,436,102	280,643	274,888
2	うち、標準的手法適用分	660,264	631,917	52,821	50,553
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,515,606	2,493,491	201,248	199,479
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	295,040	273,628	23,603	21,890
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	37,129	37,064	2,970	2,965
6	カウンターパーティ信用リスク	22,397	24,271	1,791	1,941
7	うち、SA-CCR適用分	11,376	11,513	910	921
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,155	1,148	92	91
9	その他	9,865	11,610	789	928
10	CVAリスク	19,407	23,373	1,552	1,869
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	19,407	23,373	1,552	1,869
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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)	285,873	278,550	22,869	22,284
13	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%)	-	-	-	-
14	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%)	-	-	-	-
15	未決済取引	-	-	-	-
16	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	147,131	148,961	11,770	11,916
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	147,131	148,961	11,770	11,916
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	144,441	144,441	11,555	11,555
25	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	24,789	9,934	1,983	794
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,152,083	4,065,636	332,166	325,250

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：2024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	2,809,961
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		58,221
4		ポートフォリオの質
5		34
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	2,868,217

(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：2024年6月末】
 (別紙様式第八号第六面)

(単位：百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	信用リスク	2,810,647	660,264	3,470,911	5,258,863
2	カウンターパーティ信用リスク	21,242	1,155	22,397	29,802
3	CVAリスク		19,407	19,407	24,983
4	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	-	147,131	147,131	147,131
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		144,441	144,441	144,441
7	その他リスク・アセット		347,793	347,793	341,613
8	合計	2,831,889	1,320,194	4,152,083	5,946,837

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:2024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	
		2024年 6月末	2024年 3月末	2024年 6月末	2024年 3月末
1	信用リスク	3,505,582	3,433,612	280,446	274,688
2	うち、標準的手法適用分	658,742	630,247	52,699	50,419
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,514,763	2,492,751	201,181	199,420
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	295,040	273,628	23,603	21,890
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	37,036	36,984	2,962	2,958
6	カウンターパーティ信用リスク	22,397	24,271	1,791	1,941
7	うち、SA-CCR適用分	11,376	11,513	910	921
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,155	1,148	92	91
9	その他	9,865	11,610	789	928
10	CVAリスク	19,407	23,373	1,552	1,869
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	19,407	23,373	1,552	1,869
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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)	284,339	276,959	22,747	22,156
13	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%)	-	-	-	-
14	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%)	-	-	-	-
15	未決済取引	-	-	-	-
16	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	147,131	148,961	11,770	11,916
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	147,131	148,961	11,770	11,916
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	138,925	138,925	11,114	11,114
25	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	26,687	11,781	2,134	942
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,144,471	4,057,884	331,557	324,630