

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   |          |
|                 |  | 2024年9月末  | 2024年6月末  | 2024年9月末 | 2024年6月末 |
| 1               | 信用リスク  | 3,523,713 | 3,563,299 | 281,897  | 285,063  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 725,890   | 726,960   | 58,071   | 58,156   |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 2,452,175 | 2,497,386 | 196,174  | 199,790  |
| 4               | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 295,750   | 295,040   | 23,660   | 23,603   |
| 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  | 49,896    | 43,912    | 3,991    | 3,512    |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 26,260    | 22,346    | 2,100    | 1,787    |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 15,098    | 11,324    | 1,207    | 905      |
| 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                              | 1,292     | 1,155     | 103      | 92       |
| 9               | その他  | 9,868     | 9,865     | 789      | 789      |
| 10              | CVAリスク   | 27,541    | 19,398    | 2,203    | 1,551    |
|                 | 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                                 | 27,541    | 19,398    | 2,203    | 1,551    |
| 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)       | 289,552   | 288,957   | 23,164   | 23,116   |
| 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(マデート方式)         | -         | -         | -        | -        |
|                 | 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               | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                           | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                                     | 154,645   | 149,536   | 12,371   | 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                 | 27,588    | 27,241    | 2,207    | 2,179    |
| 26              | フロア調整  | -         | -         | -        | -        |
| 27              | 合計   | 4,179,239 | 4,217,911 | 334,339  | 337,432  |

## 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9月末】  
 (別紙様式第八号第二面)

(単位:百万円)

| 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 | 2,851,633    |          |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額           | 資産の規模        | △ 69,244 |
| 3  |                         | ポートフォリオの質    | 24,787   |
| 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 | 2,807,176    |          |

(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9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                              | 2,747,926               | 725,890              | 3,473,816  | 5,221,963                                     |
| 2                                  | カウンターパーティ信用リスク                     | 24,967                  | 1,292                | 26,260     | 37,934  |
| 3                                  | CVAリスク                             |                         | 27,541               | 27,541     | 36,784  |
| 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 | -                       | 129,937              | 129,937    | 129,937                                       |
| 5                                  | マーケット・リスク                          | -                       | -                    | -          | -   |
| 6                                  | オペレーショナル・リスク                       |                         | 154,645              | 154,645    | 154,645                                       |
| 7                                  | その他リスク・アセット                        |                         | 367,037              | 367,037    | 360,064                                       |
| 8                                  | 合計                                 | 2,772,894               | 1,406,345            | 4,179,239  | 5,941,330                                     |

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   |          |
|                 |  | 2024年9月末  | 2024年6月末  | 2024年9月末 | 2024年6月末 |
| 1               | 信用リスク  | 3,473,015 | 3,508,040 | 277,841  | 280,643  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 664,527   | 660,264   | 53,162   | 52,821   |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 2,476,030 | 2,515,606 | 198,082  | 201,248  |
| 4               | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 295,750   | 295,040   | 23,660   | 23,603   |
| 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  | 36,706    | 37,129    | 2,936    | 2,970    |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 26,281    | 22,397    | 2,102    | 1,791    |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 15,119    | 11,376    | 1,209    | 910      |
| 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                              | 1,292     | 1,155     | 103      | 92       |
| 9               | その他  | 9,868     | 9,865     | 789      | 789      |
| 10              | CVAリスク   | 27,545    | 19,407    | 2,203    | 1,552    |
|                 | 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                                 | 27,545    | 19,407    | 2,203    | 1,552    |
| 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)       | 285,653   | 285,873   | 22,852   | 22,869   |
| 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               | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                           | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                                     | 146,725   | 144,441   | 11,738   | 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                 | 25,153    | 24,789    | 2,012    | 1,983    |
| 26              | フロア調整  | -         | -         | -        | -        |
| 27              | 合計   | 4,114,313 | 4,152,083 | 329,145  | 332,166  |

## 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 | 2,868,217    |          |
| 2  | 当四半期中の要因別<br>の変動額       | 資産の規模        | △ 68,183 |
| 3  |                         | ポートフォリオの質    | 29,491   |
| 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 | 2,829,525    |          |

(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9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                              | 2,771,781               | 664,527              | 3,436,308  | 5,183,075                                     |
| 2                                  | カウンターパーティ信用リスク                     | 24,988                  | 1,292                | 26,281     | 37,966  |
| 3                                  | CVAリスク                             |                         | 27,545               | 27,545     | 36,793  |
| 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 | -                       | 129,937              | 129,937    | 129,937                                       |
| 5                                  | マーケット・リスク                          | -                       | -                    | -          | -   |
| 6                                  | オペレーショナル・リスク                       |                         | 146,725              | 146,725    | 146,725                                       |
| 7                                  | その他リスク・アセット                        |                         | 347,514              | 347,514    | 340,548                                       |
| 8                                  | 合計                                 | 2,796,770               | 1,317,542            | 4,114,313  | 5,875,047                                     |

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   |          |
|                 |  | 2024年9月末  | 2024年6月末  | 2024年9月末 | 2024年6月末 |
| 1               | 信用リスク  | 3,470,763 | 3,505,582 | 277,661  | 280,446  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 663,296   | 658,742   | 53,063   | 52,699   |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 2,475,102 | 2,514,763 | 198,008  | 201,181  |
| 4               | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 295,750   | 295,040   | 23,660   | 23,603   |
| 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  | 36,612    | 37,036    | 2,929    | 2,962    |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 26,281    | 22,397    | 2,102    | 1,791    |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 15,119    | 11,376    | 1,209    | 910      |
| 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                              | 1,292     | 1,155     | 103      | 92       |
| 9               | その他  | 9,868     | 9,865     | 789      | 789      |
| 10              | CVAリスク   | 27,545    | 19,407    | 2,203    | 1,552    |
|                 | 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                                 | 27,545    | 19,407    | 2,203    | 1,552    |
| 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)       | 284,108   | 284,339   | 22,728   | 22,747   |
| 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               | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                           | 129,937   | 147,131   | 10,395   | 11,770   |
| 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                                     | 142,561   | 138,925   | 11,404   | 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                 | 27,430    | 26,687    | 2,194    | 2,134    |
| 26              | フロア調整  | -         | -         | -        | -        |
| 27              | 合計   | 4,108,628 | 4,144,471 | 328,690  | 331,557  |