

自己資本比率告示第2条[第14条]各号の算式における分母の額に関する開示事項（2020年3月期 第1四半期末）

（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要(連結)					
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	
		当四半期末 2019年6月期	前四半期末 2019年3月期	当四半期末 2019年6月期	前四半期末 2019年3月期
1	信用リスク	2,046,235	2,083,267	173,061	176,197
2	うち、標準的手法適用分	4,752	5,092	380	407
3	うち、内部格付手法適用分	1,950,581	1,986,626	165,409	168,465
	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	90,901	91,548	7,272	7,323
4	カウンターパーティ信用リスク	11,302	11,199	924	917
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	3,651	3,370	309	285
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,982	6,601	558	528
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16	13	1	1
	その他	652	1,213	55	102
7	マーケット・ベース方式にもとづく株式等エクスポージャー	15,274	8,573	1,295	726
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	90,603	88,269	7,681	7,483
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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
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	10,332	10,408	826	832
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	27,724	27,185	2,217	2,174
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	27,724	27,185	2,217	2,174
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	105,442	105,442	8,435	8,435
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	105,442	105,442	8,435	8,435
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	2,169	1,416	184	120
	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	223,536	191,643	17,882	15,331
25	合計	2,532,621	2,527,405	212,509	212,219
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,656,372	2,652,748		

(単位:百万円)

OV1 : リスク・アセットの概要(単体)

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	
		当四半期末	前四半期末	当四半期末	前四半期末
		2019年6月期	2019年3月期	2019年6月期	2019年3月期
1	信用リスク	2,024,603	2,061,284	171,390	174,498
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,962,878	1,999,094	166,452	169,523
	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	61,725	62,189	4,938	4,975
4	カウンターパーティ信用リスク	11,302	11,199	924	917
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	3,651	3,370	309	285
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,982	6,601	558	528
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16	13	1	1
	その他	652	1,213	55	102
7	マーケット・ベース方式にもとづく株式等エクスポージャー	6,662	30	564	2
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	92,505	90,172	7,842	7,644
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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
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	10,332	10,408	826	832
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	27,724	27,185	2,217	2,174
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	27,724	27,185	2,217	2,174
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	98,466	98,466	7,877	7,877
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	98,466	98,466	7,877	7,877
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	-	-	-	-
	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	233,482	200,577	18,678	16,046
25	合計	2,505,080	2,499,324	210,322	209,994
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,629,036	2,624,932		

(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(連結)			
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	1,986,626	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	▲ 26,947
3		ポートフォリオの質	▲ 15,256
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	6,158
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	1,950,581

(注)項番8「その他」には、項番2「資産の規模」と項番3「ポートフォリオの質」の両方に該当する額等を計上しています。

**CCR7 : 期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ
信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表**

当行は、与信相当額の算出に当たり、期待エクスポージャー方式を用いておりません。

MR2 : 内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

当行は、自己資本比率算出上、マーケット・リスク相当額に係る額を不算入としております。