

## 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 中間期末）

(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<br>2019年9月期 | 前四半期末<br>2019年6月期 | 当四半期末<br>2019年9月期 | 前四半期末<br>2019年6月期 |
| 1                   | 信用リスク  | 2,036,367         | 2,046,235         | 172,226           | 173,061           |
| 2                   | うち、標準的手法適用分                                      | 5,192             | 4,752             | 415               | 380               |
| 3                   | うち、内部格付手法適用分                                     | 1,941,021         | 1,950,581         | 164,598           | 165,409           |
|                     | 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  | 90,154            | 90,901            | 7,212             | 7,272             |
| 4                   | カウンターパーティ信用リスク                                   | 10,851            | 11,302            | 887               | 924               |
| 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                            | 3,461             | 3,651             | 293               | 309               |
| 6                   | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                     | うち、CVAリスク  | 6,699             | 6,982             | 535               | 558               |
|                     | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 20                | 16                | 1                 | 1                 |
|                     | その他  | 670               | 652               | 56                | 55                |
| 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                      | 18,972            | 15,274            | 1,608             | 1,295             |
| 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）      | 86,553            | 90,603            | 7,338             | 7,681             |
| 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（マンドレート方式）       | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                     | 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%） | 10,685            | 10,332            | 854               | 826               |
| 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               | 28,317            | 27,724            | 2,265             | 2,217             |
| 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                                   | 28,317            | 27,724            | 2,265             | 2,217             |
| 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                                     | 103,743           | 105,442           | 8,299             | 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                                    | 103,743           | 105,442           | 8,299             | 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                 | 1,677             | 2,169             | 142               | 184               |
|                     | 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  | 203,097           | 223,536           | 16,247            | 17,882            |
| 25                  | 合計   | 2,500,266         | 2,532,621         | 209,871           | 212,509           |
|                     | 参考：合計(スケーリングファクター勘案後)                            | 2,623,395         | 2,656,372         |                   |                   |

(単位:百万円)

| OV1 : リスク・アセットの概要(単体) |  | イ         | ロ         | ハ        | ニ        |
|-----------------------|--|-----------|-----------|----------|----------|
| 国際様式<br>の該<br>当番号     |  | 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9月期  | 2019年6月期  | 2019年9月期 | 2019年6月期 |
| 1                     | 信用リスク  | 2,013,558 | 2,024,603 | 170,463  | 171,390  |
| 2                     | うち、標準的手法適用分                                      | -         | -         | -        | -        |
| 3                     | うち、内部格付手法適用分                                     | 1,953,933 | 1,962,878 | 165,693  | 166,452  |
|                       | 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  | 59,625    | 61,725    | 4,770    | 4,938    |
| 4                     | カウンターパーティ信用リスク                                   | 10,851    | 11,302    | 887      | 924      |
| 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                            | 3,461     | 3,651     | 293      | 309      |
| 6                     | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -         | -         | -        | -        |
|                       | うち、CVAリスク  | 6,699     | 6,982     | 535      | 558      |
|                       | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 20        | 16        | 1        | 1        |
|                       | その他  | 670       | 652       | 56       | 55       |
| 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                      | 10,080    | 6,662     | 854      | 564      |
| 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)      | 88,351    | 92,505    | 7,491    | 7,842    |
| 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(マンドレート方式)       | -         | -         | -        | -        |
|                       | 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%) | 10,685    | 10,332    | 854      | 826      |
| 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               | 28,317    | 27,724    | 2,265    | 2,217    |
| 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                                   | 28,317    | 27,724    | 2,265    | 2,217    |
| 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                                     | 96,794    | 98,466    | 7,743    | 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                                    | 96,794    | 98,466    | 7,743    | 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  | 217,435   | 233,482   | 17,394   | 18,678   |
| 25                    | 合計   | 2,476,074 | 2,505,080 | 207,956  | 210,322  |
|                       | 参考：合計(スケーリングファクター勘案後)                            | 2,599,451 | 2,629,036 |          |          |

(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 | 1,950,581               |           |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額           | 資産の規模                   | 27,910    |
| 3  |                         | ポートフォリオの質               | ▲ 43,583  |
| 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                     | 6,112     |
| 9  |                         | 当四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 1,941,021 |

(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。