

## 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（2021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 2020年6月期	前四半期末 2020年3月期	当四半期末 2020年6月期	前四半期末 2020年3月期
1	信用リスク	2,100,783	2,045,959	177,699	173,046
2	うち、標準的手法適用分	4,635	5,057	370	404
3	うち、内部格付手法適用分	2,007,730	1,952,133	170,255	165,540
	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	88,417	88,768	7,073	7,101
4	カウンターパーティ信用リスク	14,628	14,172	1,195	1,163
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	4,263	3,897	361	330
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	9,334	7,948	746	635
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	32	1	2
	その他	1,010	2,292	85	194
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	17,730	12,171	1,503	1,032
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）	120,022	104,367	10,172	8,847
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%）	11,067	11,199	885	895
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	29,159	29,003	2,332	2,320
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	29,159	29,003	2,332	2,320
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	101,886	101,886	8,150	8,150
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	101,886	101,886	8,150	8,150
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	1,666	1,666	141	141
	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	265,430	212,254	21,234	16,980
25	合計	2,662,374	2,532,681	223,316	212,579
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,791,452	2,657,243		

(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 2020年6月期	前四半期末 2020年3月期	当四半期末 2020年6月期	前四半期末 2020年3月期
1	信用リスク	2,079,974	2,023,869	176,097	171,343
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,020,741	1,965,308	171,358	166,658
	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	59,232	58,560	4,738	4,684
4	カウンターパーティ信用リスク	14,628	14,172	1,195	1,163
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	4,263	3,897	361	330
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	9,334	7,948	746	635
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	32	1	2
	その他	1,010	2,292	85	194
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	8,608	3,567	730	302
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)	121,808	106,153	10,323	8,999
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%)	11,067	11,199	885	895
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	29,159	29,003	2,332	2,320
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	29,159	29,003	2,332	2,320
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	95,515	95,515	7,641	7,641
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	95,515	95,515	7,641	7,641
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	279,581	226,072	22,366	18,085
25	合計	2,640,342	2,509,554	221,572	210,751
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,769,660	2,634,398		

(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	1,952,133	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	63,749
3		ポートフォリオの質	▲ 12,021
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	3,869
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,007,730

(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。