

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 中間期末）

(単位:百万円)

0V1：リスク・アセットの概要(連結)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		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
		2020年9月期	2020年6月期	2020年9月期	2020年6月期
1	信用リスク	2,161,155	2,100,783	182,846	177,699
2	うち、標準的手法適用分	4,966	4,635	397	370
3	うち、内部格付手法適用分	2,073,687	2,007,730	175,848	170,255
	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	82,501	88,417	6,600	7,073
4	カウンターパーティ信用リスク	20,848	14,628	1,700	1,195
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	5,950	4,263	504	361
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	14,086	9,334	1,126	746
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	14	19	1	1
	その他	797	1,010	67	85
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	15,846	17,730	1,343	1,503
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）	133,818	120,022	11,345	10,172
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%）	10,907	11,067	872	885
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	30,071	29,159	2,405	2,332
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	30,071	29,159	2,405	2,332
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	100,888	101,886	8,071	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	100,888	101,886	8,071	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	1,727	1,666	146	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	91,933	265,430	7,354	21,234
25	合計	2,567,198	2,662,374	216,086	223,316
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,701,078	2,791,452		

(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9月期	前四半期末 2020年6月期	当四半期末 2020年9月期	前四半期末 2020年6月期
1	信用リスク	2,143,636	2,079,974	181,520	176,097
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,089,576	2,020,741	177,196	171,358
	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	54,059	59,232	4,324	4,738
4	カウンターパーティ信用リスク	20,848	14,628	1,700	1,195
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	5,950	4,263	504	361
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	14,086	9,334	1,126	746
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	14	19	1	1
	その他	797	1,010	67	85
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	6,361	8,608	539	730
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)	135,580	121,808	11,494	10,323
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%)	10,907	11,067	872	885
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	30,071	29,159	2,405	2,332
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	30,071	29,159	2,405	2,332
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	95,024	95,515	7,601	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	95,024	95,515	7,601	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	102,046	279,581	8,163	22,366
25	合計	2,544,478	2,640,342	214,299	221,572
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,678,744	2,769,660		

(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	2,007,730	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	65,037
3		ポートフォリオの質	▲ 7,488
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	8,408
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,073,687

(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。