

## 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（2022年3月期 第3四半期末）

(単位:百万円)

0V1：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 2021年12月期	前四半期末 2021年9月期	当四半期末 2021年12月期	前四半期末 2021年9月期
1	信用リスク	2,345,202	2,337,422	198,457	197,806
2	うち、標準的手法適用分	7,275	5,257	582	420
3	うち、内部格付手法適用分	2,258,623	2,252,701	191,531	191,029
	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	79,303	79,463	6,344	6,357
4	カウンターパーティ信用リスク	33,635	37,718	2,772	3,099
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	6,487	7,384	550	626
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,595	20,576	1,327	1,646
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	34	10	2	-
	その他	10,518	9,746	891	826
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	8,659	20,332	734	1,724
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）	128,482	132,926	10,882	11,272
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%）	6,033	4,013	511	340
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%）	10,529	10,780	842	862
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	28,407	29,405	2,272	2,352
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	28,407	29,405	2,272	2,352
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	104,562	104,562	8,365	8,365
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	104,562	104,562	8,365	8,365
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	780	780	66	66
	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	-	-	-	-
25	合計	2,666,293	2,677,941	224,904	225,889
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,811,312	2,823,614		

(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 2021年12月期	前四半期末 2021年9月期	当四半期末 2021年12月期	前四半期末 2021年9月期
1	信用リスク	2,326,551	2,320,089	197,023	196,479
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,270,684	2,265,008	192,554	192,072
	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	55,866	55,081	4,469	4,406
4	カウンターパーティ信用リスク	33,635	37,718	2,772	3,099
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	6,487	7,384	550	626
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,595	20,576	1,327	1,646
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	34	10	2	-
	その他	10,518	9,746	891	826
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	21	10,932	1	927
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)	129,002	133,498	10,931	11,320
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%)	6,033	4,013	511	340
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%)	10,529	10,780	842	862
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	28,407	29,405	2,272	2,352
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	28,407	29,405	2,272	2,352
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	99,319	99,319	7,945	7,945
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	99,319	99,319	7,945	7,945
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	-	-	-	-
25	合計	2,633,502	2,645,757	222,301	223,327
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,778,765	2,791,592		

(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	2,252,701	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	27,979
3		ポートフォリオの質	▲ 21,787
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	▲ 270
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,258,623

(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。