

## 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 2022年3月期	前四半期末 2021年12月期	当四半期末 2022年3月期	前四半期末 2021年12月期
1	信用リスク	2,347,210	2,345,202	198,638	198,457
2	うち、標準的手法適用分	5,699	7,275	455	582
3	うち、内部格付手法適用分	2,262,844	2,258,623	191,889	191,531
	うち、重要な出資のエクスポージャー	0	-	0	-
	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	0	-	0	-
	その他	78,666	79,303	6,293	6,344
4	カウンターパーティ信用リスク	46,330	33,635	3,795	2,772
5	うち、SA-CCR適用分	0	-	0	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	7,826	6,487	663	550
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	0	-	0	-
	うち、CVAリスク	27,668	16,595	2,213	1,327
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79	34	6	2
	その他	10,754	10,518	912	891
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	8,538	8,659	724	734
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）	152,176	128,482	12,893	10,882
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）	0	-	0	-
	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%）	0	-	0	-
	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%）	8,077	6,033	684	511
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%）	10,707	10,529	856	842
11	未決済取引	0	-	0	-
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	27,870	28,407	2,229	2,272
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	0	-	0	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	27,870	28,407	2,229	2,272
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	0	-	0	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	0	-	0	-
16	マーケット・リスク	0	-	0	-
17	うち、標準的方式適用分	0	-	0	-
18	うち、内部モデル方式適用分	0	-	0	-
19	オペレーショナル・リスク	107,699	104,562	8,615	8,365
20	うち、基礎的手法適用分	0	-	0	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	107,699	104,562	8,615	8,365
22	うち、先進的計測手法適用分	0	-	0	-
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	1,178	780	99	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	0	-	0	-
24	フロア調整	0	-	0	-
25	合計	2,709,787	2,666,293	228,539	224,904
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,856,737	2,811,312		

(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
		2022年3月期	2021年12月期	2022年3月期	2021年12月期
1	信用リスク	2,330,471	2,326,551	197,356	197,023
2	うち、標準的手法適用分	0	-	0	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,274,749	2,270,684	192,898	192,554
	うち、重要な出資のエクスポージャー	0	-	0	-
	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	0	-	0	-
	その他	55,721	55,866	4,457	4,469
4	カウンターパーティ信用リスク	46,330	33,635	3,795	2,772
5	うち、SA-CCR適用分	0	-	0	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	7,826	6,487	663	550
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	0	-	0	-
	うち、CVAリスク	27,668	16,595	2,213	1,327
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	79	34	6	2
	その他	10,754	10,518	912	891
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	22	21	1	1
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)	153,198	129,002	12,982	10,931
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)	0	-	0	-
	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%)	0	-	0	-
	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%)	8,077	6,033	684	511
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%)	10,707	10,529	856	842
11	未決済取引	0	-	0	-
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	27,870	28,407	2,229	2,272
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	0	-	0	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	27,870	28,407	2,229	2,272
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	0	-	0	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	0	-	0	-
16	マーケット・リスク	0	-	0	-
17	うち、標準的方式適用分	0	-	0	-
18	うち、内部モデル方式適用分	0	-	0	-
19	オペレーショナル・リスク	102,247	99,319	8,179	7,945
20	うち、基礎的手法適用分	0	-	0	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	102,247	99,319	8,179	7,945
22	うち、先進的計測手法適用分	0	-	0	-
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	0	-	0	-
	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	0	-	0	-
24	フロア調整	0	-	0	-
25	合計	2,678,923	2,633,502	226,087	222,301
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,826,089	2,778,765		

(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	2,258,623	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	5,986
3		ポートフォリオの質	▲ 1,760
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	▲ 4
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,262,844

(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。