

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（2023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 2022年6月期	前四半期末 2022年3月期	当四半期末 2022年6月期	前四半期末 2022年3月期
1	信用リスク	2,321,253	2,347,210	196,419	198,638
2	うち、標準的手法適用分	5,514	5,699	441	455
3	うち、内部格付手法適用分	2,233,140	2,262,844	189,370	191,889
	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	82,598	78,666	6,607	6,293
4	カウンターパーティ信用リスク	70,410	46,330	5,748	3,795
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	13,014	7,826	1,103	663
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	46,163	27,668	3,693	2,213
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	117	79	9	6
	その他	11,114	10,754	942	912
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	13,858	8,538	1,175	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）	193,882	152,176	16,336	12,893
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%）	-	8,077	-	684
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%）	10,590	10,707	847	856
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	28,445	27,870	2,275	2,229
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	28,445	27,870	2,275	2,229
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	107,699	107,699	8,615	8,615
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	107,699	107,699	8,615	8,615
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	1,175	1,178	99	99
	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	2,747,316	2,709,787	231,517	228,539
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,893,972	2,856,737		

(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6月期	2022年3月期	2022年6月期	2022年3月期
1	信用リスク	2,301,382	2,330,471	194,879	197,356
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,243,541	2,274,749	190,252	192,898
	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	57,841	55,721	4,627	4,457
4	カウンターパーティ信用リスク	70,410	46,330	5,748	3,795
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	13,014	7,826	1,103	663
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	46,163	27,668	3,693	2,213
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	117	79	9	6
	その他	11,114	10,754	942	912
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	5,889	22	499	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)	194,895	153,198	16,406	12,982
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(マニフェスト方式)	-	-	-	-
	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%)	-	8,077	-	684
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%)	10,590	10,707	847	856
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	28,445	27,870	2,275	2,229
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	28,445	27,870	2,275	2,229
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	102,247	102,247	8,179	8,179
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	102,247	102,247	8,179	8,179
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	2,713,861	2,678,923	228,836	226,087
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,860,460	2,826,089		

(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	2,262,844
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 167,762
3		ポートフォリオの質 149,113
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 ▲ 11,054
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額

(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。