

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 中間期末）

（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9月期	前四半期末 2022年6月期	当四半期末 2022年9月期	前四半期末 2022年6月期
1	信用リスク	2,326,445	2,321,253	196,861	196,419
2	うち、標準的手法適用分	5,543	5,514	443	441
3	うち、内部格付手法適用分	2,238,634	2,233,140	189,836	189,370
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	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	-
	その他	82,267	82,598	6,581	6,607
4	カウンターパーティ信用リスク	85,709	70,410	6,980	5,748
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	0	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	15,156	13,014	1,285	1,103
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	0	-
	うち、CVAリスク	59,752	46,163	4,780	3,693
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	147	117	11	9
	その他	10,653	11,114	903	942
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	17,733	13,858	1,503	1,175
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）	195,580	193,882	16,560	16,336
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（マंडレート方式）	-	-	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	-
	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%）	-	-	0	-
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%）	9,877	10,590	790	847
11	未決済取引	-	-	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	28,950	28,445	2,316	2,275
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	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	28,950	28,445	2,316	2,275
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	0	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	0	-
16	マーケット・リスク	-	-	0	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	0	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	0	-
19	オペレーショナル・リスク	116,981	107,699	9,358	8,615
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	0	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	116,981	107,699	9,358	8,615
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	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	1,165	1,175	98	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	-	-	0	-
24	フロア調整	-	-	0	-
25	合計	2,782,444	2,747,316	234,470	231,517
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,930,876	2,893,972		

(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 2022年9月期	前四半期末 2022年6月期	当四半期末 2022年9月期	前四半期末 2022年6月期
1	信用リスク	2,308,149	2,301,382	195,452	194,879
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,250,172	2,243,541	190,814	190,252
	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	57,977	57,841	4,638	4,627
4	カウンターパーティ信用リスク	85,709	70,410	6,980	5,748
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	15,156	13,014	1,285	1,103
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	59,752	46,163	4,780	3,693
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	147	117	11	9
	その他	10,653	11,114	903	942
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	9,305	5,889	789	499
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)	196,733	194,895	16,661	16,406
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%)	9,877	10,590	790	847
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	28,950	28,445	2,316	2,275
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	28,950	28,445	2,316	2,275
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	111,893	102,247	8,951	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	111,893	102,247	8,951	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	2,750,619	2,713,861	231,942	228,836
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,899,277	2,860,460		

(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	2,233,140
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 55,269
3		ポートフォリオの質 62,304
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 ▲ 1,542
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。