

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 2022年12月期	前四半期末 2022年9月期	当四半期末 2022年12月期	前四半期末 2022年9月期
1	信用リスク	2,366,362	2,326,445	200,224	196,861
2	うち、標準的手法適用分	7,139	5,543	571	443
3	うち、内部格付手法適用分	2,274,100	2,238,634	192,843	189,836
	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	85,122	82,267	6,809	6,581
4	カウンターパーティ信用リスク	95,310	85,709	7,757	6,980
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	18,506	15,156	1,569	1,285
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	67,253	59,752	5,380	4,780
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	499	147	39	11
	その他	9,051	10,653	767	903
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	15,664	17,733	1,328	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）	245,537	195,580	20,792	16,560
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%）	10,637	9,877	851	790
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	28,642	28,950	2,291	2,316
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	28,642	28,950	2,291	2,316
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	116,981	116,981	9,358	9,358
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	116,981	116,981	9,358	9,358
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	1,165	1,165	98	98
	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	2,880,301	2,782,444	242,702	234,470
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	3,033,785	2,930,876		

(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12月期	2022年9月期	2022年12月期	2022年9月期
1	信用リスク	2,345,888	2,308,149	198,641	195,452
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,285,506	2,250,172	193,810	190,814
	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	60,381	57,977	4,830	4,638
4	カウンターパーティ信用リスク	95,310	85,709	7,757	6,980
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	18,506	15,156	1,569	1,285
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	67,253	59,752	5,380	4,780
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	499	147	39	11
	その他	9,051	10,653	767	903
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	7,451	9,305	631	789
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)	246,744	196,733	20,900	16,661
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%)	10,637	9,877	851	790
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	28,642	28,950	2,291	2,316
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	28,642	28,950	2,291	2,316
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	111,893	8,951	8,951
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	111,893	8,951	8,951
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	2,846,568	2,750,619	240,025	231,942
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	3,000,315	2,899,277		

(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	2,238,634	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	38,146
3		ポートフォリオの質	▲ 2,636
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	▲ 44
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,274,100

(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。