

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月期末)

(単位:百万円)

OV1 : リスク・アセットの概要(連結)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 2023年3月期	前四半期末	当四半期末 2023年3月期	前四半期末
1	信用リスク	2,229,578	-	178,366	-
2	うち、標準的手法適用分	31,381	-	2,510	-
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,028,227	-	162,258	-
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	110,003	-	8,800	-
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	59,966	-	4,797	-
6	カウンターパーティ信用リスク	13,429	-	1,074	-
7	うち、SA-CCR適用分	2,728	-	218	-
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	868	-	69	-
9	その他	9,832	-	786	-
10	CVAリスク	16,192	-	1,295	-
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	16,192	-	1,295	-
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	19,424	-	1,553	-
12	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)	174,537	-	13,962	-
13	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%)	-	-	-	-
14	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%)	8,433	-	674	-
15	未決済取引	-	-	-	-
16	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	28,872	-	2,309	-
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	28,872	-	2,309	-
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	115,659	-	9,252	-
25	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	949	-	75	-
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,607,077	-	208,566	-

※規制改正により様式が変更となった為、前四半期末については【別紙1】にて開示いたします。

OV1：リスク・アセットの概要(単体)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 2023年3月期	前四半期末	当四半期末 2023年3月期	前四半期末
		1	信用リスク	2, 208, 833	-
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2, 039, 175	-	163, 134	-
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	110, 003	-	8, 800	-
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	59, 653	-	4, 772	-
6	カウンターパーティ信用リスク	13, 429	-	1, 074	-
7	うち、SA-CCR適用分	2, 728	-	218	-
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	868	-	69	-
9	その他	9, 832	-	786	-
10	CVAリスク	16, 192	-	1, 295	-
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	16, 192	-	1, 295	-
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	10, 979	-	878	-
12	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)	175, 456	-	14, 036	-
13	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)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
14	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%)	8, 433	-	674	-
15	未決済取引	-	-	-	-
16	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, 872	-	2, 309	-
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	28, 872	-	2, 309	-
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	105, 523	-	8, 441	-
25	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	-	-	-	-
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2, 567, 720	-	205, 417	-

※規制改正により様式が変更となった為、前四半期末については【別紙1】にて開示いたします。

(単位:百万円)

CR8 : 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表 (連結)			
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	2,274,100	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	119,504
3		ポートフォリオの質	85,202
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	▲ 332,696
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	▲ 7,881
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,138,230

(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 : 内部モデル方式によるマーケット・リスク相当額に関する内訳

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。

CVA4 : CVA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、CVAリスク算出にあたりSA-CVAを用いておりません。

(単位:百万円)

CMS1 : 内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額 (フロア掛目前)
1	信用リスク	2,138,230	31,381	2,169,611	3,167,868
2	カウンターパーティ信用リスク	12,560	868	13,429	67,789
3	CVAリスク		16,192	16,192	17,811
4	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	-	28,872	28,872	28,872
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		115,659	115,659	115,659
7	その他リスク・アセット		263,312	263,312	163,890
8	合計	2,150,791	456,286	2,607,077	3,561,892

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月期末)
(旧様式による前四半期末の開示)

(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	前四半期末 2022年12月期	当四半期末	前四半期末 2022年12月期
1	信用リスク		2,366,362		200,224
2	うち、標準的手法適用分		7,139		571
3	うち、内部格付手法適用分		2,274,100		192,843
	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		6,809
4	カウンターパーティ信用リスク		95,310		7,757
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		1,569
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		5,380
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		499		39
	その他		9,051		767
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		1,328
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		20,792
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)		-		-
	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		851
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		2,291
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		2,291
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		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		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		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		242,702
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)		3,033,785		

(単位:百万円)

0V1 : 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 2022年12月期	当四半期末	前四半期末 2022年12月期
1	信用リスク		2,345,888		198,641
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		193,810
	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		4,830
4	カウンターパーティ信用リスク		95,310		7,757
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		1,569
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		5,380
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		499		39
	その他		9,051		767
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		631
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		20,900
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%)		-		-
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		851
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		2,291
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		2,291
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		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		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		240,025
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)		3,000,315		