

定量的な開示事項

- 1.その他金融機関等(自己資本比率告示第8条第8項第1号に規定するその他金融機関等をいう。)であって銀行の子法人等であるもののうち、自己資本比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称および所要自己資本を下回った額の総額

該当ありません。

- 2.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が適用されるエクスポージャーの額

連結

(単位 百万円)

		2020年度中間期	2019年度中間期
ルックスルー方式	(告示第167条第2項)	101,302	78,119
マンドート方式	(告示第167条第7項)	—	—
蓋然性方式RW250%	(告示第167条第10項第1号)	—	—
蓋然性方式RW400%	(告示第167条第10項第2号)	—	—
フォールバック方式	(告示第167条第11項)	872	854
合計		102,174	78,974

3.別紙様式による開示事項

OV1: リスク・アセットの概要

連結

(単位 百万円)

国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	信用リスク	2,161,155	2,036,367	182,846	172,226
2	うち、標準的手法適用分	4,966	5,192	397	415
3	うち、内部格付手法適用分	2,073,687	1,941,021	175,848	164,598
	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	82,501	90,154	6,600	7,212
4	カウンターパーティ信用リスク	20,848	10,851	1,700	887
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	5,950	3,461	504	293
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	14,086	6,699	1,126	535
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	14	20	1	1
	その他	797	670	67	56
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	15,846	18,972	1,343	1,608
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)	133,818	86,553	11,345	7,338
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1,250%)	10,907	10,685	872	854
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	30,071	28,317	2,405	2,265
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	30,071	28,317	2,405	2,265
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1,250%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	100,888	103,743	8,071	8,299
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	100,888	103,743	8,071	8,299
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	1,727	1,677	146	142
24	フロア調整	91,933	203,097	7,354	16,247
25	合計	2,567,198	2,500,266	216,086	209,871
	参考:合計(スケーリングファクター勘案後)	2,701,078	2,623,395		

単体

(単位 百万円)

国際様式 の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		イ	ロ	ハ	ニ
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	信用リスク	2,143,636	2,013,558	181,520	170,463
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,089,576	1,953,933	177,196	165,693
	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	54,059	59,625	4,324	4,770
4	カウンターパーティ信用リスク	20,848	10,851	1,700	887
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	5,950	3,461	504	293
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	14,086	6,699	1,126	535
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	14	20	1	1
	その他	797	670	67	56
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	6,361	10,080	539	854
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)	135,580	88,351	11,494	7,491
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1,250%)	10,907	10,685	872	854
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	30,071	28,317	2,405	2,265
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	30,071	28,317	2,405	2,265
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1,250%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	95,024	96,794	7,601	7,743
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	95,024	96,794	7,601	7,743
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	102,046	217,435	8,163	17,394
25	合計	2,544,478	2,476,074	214,299	207,956
	参考:合計(スケーリングファクター勘案後)	2,678,744	2,599,451		

CR1：資産の信用の質

連結

(2020年度中間期)

(単位 百万円)

項番		帳簿価額の総額		引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)
		イ	ロ		
		デフォルトした エクスポージャー	非デフォルト エクスポージャー		
	オン・バランスシートの資産				
1	貸出金	75,765	3,889,403	27,401	3,937,768
2	有価証券(うち負債性のもの)	598	923,274	—	923,873
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	351	1,213,059	985	1,212,425
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	76,715	6,025,738	28,386	6,074,067
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	1,295	28,778	127	29,946
6	コミットメント等	290	206,330	—	206,621
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	1,586	235,109	127	236,568
	合計				
8	合計(4+7)	78,302	6,260,847	28,514	6,310,635

(注1) CR1からCR10は、OV1 [リスク・アセットの概要(連結)]における「1.信用リスク」に関するエクスポージャーを対象として作成しております(与信性のない資産を除く)。

(注2) 項番2「有価証券(うち負債性のもの)」には、国債、地方債、社債、その他の証券(株式等エクスポージャーとしている資産を除く)に関する額を計上しています(CR3において同じ)。

(注3) 項番3「その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)」には、預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭信託、外国為替、貸出金未収利息に関する額、並びに「[その他資産]のうち与信性のものの額を計上しています(CR3において同じ)。

(注4) デフォルト定義は、自己資本比率第71条第1項、第205条第1項と整合的な定義としております。

(2019年度中間期)

(単位 百万円)

項番	イ		ロ	ハ	ニ
	帳簿価額の総額		引当金	ネット金額 (イ+ロ-ハ)	
	デフォルトした エクスポージャー	非デフォルト エクスポージャー			
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	61,719	3,712,664	26,106	3,748,277
2	有価証券(うち負債性のもの)	246	945,870	—	946,117
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	131	834,617	930	833,818
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	62,097	5,493,152	27,036	5,528,213
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	663	28,814	160	29,317
6	コミットメント等	99	182,344	—	182,443
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	762	211,158	160	211,760
合計					
8	合計(4+7)	62,860	5,704,310	27,196	5,739,974

(注1) CR1からCR10は、OV1 [リスク・アセットの概要(連結)]における「1.信用リスク」に関するエクスポージャーを対象として作成しております(与信のない資産を除く)。
(注2) 項番2「有価証券(うち負債性のもの)」には、国債、地方債、社債、その他の証券(株式等エクスポージャーとしている資産を除く)に関する額を計上しています(CR3において同じ)。
(注3) 項番3「その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)」には、預け金、コールローン、買入手形、買入金銭債権、金銭信託、外国為替、貸出金未収利息に関する額、並びに「その他資産」のうち与信性のものを計上しています(CR3において同じ)。
(注4) デフォルト定義は、自己資本比率報告第71条第1項、第205条第1項と整合的な定義としております。

CR2：デフォルトした貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高の変動

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	額	
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	66,752
2	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間期中の要 因別の変動額	10,713
3	デフォルトした額	2,083
4	非デフォルト状態へ復帰した額	1,096
5	償却された額	2,429
6	その他の変動額	76,715
6	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高(1+2-3-4+5)	76,715

(注1) 本表の対象資産は、CR1における「貸出金」「有価証券(うち負債性のもの)」「その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)」の額です。
(注2) 項番5「その他の変動額」には、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収・売却による残高減少や、デフォルト期間中の追加与信額等を計上しています。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	額	
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	61,047
2	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間期中の要 因別の変動額	10,703
3	デフォルトした額	5,580
4	非デフォルト状態へ復帰した額	1,206
5	償却された額	△ 2,865
6	その他の変動額	62,097
6	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高(1+2-3-4+5)	62,097

(注1) 本表の対象資産は、CR1における「貸出金」「有価証券(うち負債性のもの)」「その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)」の額です。
(注2) 項番5「その他の変動額」には、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収・売却による残高減少や、デフォルト期間中の追加与信額等を計上しています。

CR3：信用リスク削減手法

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	イ		ロ	ハ	ニ	ホ
	非保全エクスポージャー	保全されたエクスポージャー	担保で保全されたエクスポージャー	保証で保全されたエクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全されたエクスポージャー	
1	貸出金	3,377,157	560,611	227,288	122,823	—
2	有価証券(負債性のもの)	920,124	3,749	2,077	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	1,212,362	62	60	—	—
4	合計(1+2+3)	5,509,643	564,423	229,426	122,823	—
5	うち、デフォルトしたもの	38,820	17,667	4,525	8,516	—

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	イ		ロ	ハ	ニ	ホ
	非保全エクスポージャー	保全されたエクスポージャー	担保で保全されたエクスポージャー	保証で保全されたエクスポージャー	クレジット・デリバティブで保全されたエクスポージャー	
1	貸出金	3,276,632	471,644	220,522	57,071	—
2	有価証券(負債性のもの)	942,438	3,678	2,195	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	833,749	69	66	—	—
4	合計(1+2+3)	5,052,820	475,392	222,784	57,071	—
5	うち、デフォルトしたもの	30,226	13,493	3,511	6,379	—

CR4：標準的手法 - 信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	資産クラス	イ		ロ		ハ		ニ		ホ	ヘ
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額		リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)			
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額						
1	現金	1	—	1	—	—	—	—	—		
2	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
4	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	122	—	122	—	24	20.00%				
12	法人等向け	1,417	—	1,417	—	1,417	100.00%				
13	中小企業等向け及び個人向け	4,264	—	4,264	—	3,198	75.00%				
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—				
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—				
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	333	—	333	—	325	97.51%				
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—				
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—				
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—				
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—				
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—				
22	合計	6,140	—	6,140	—	4,966	80.87%				

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	資産クラス	イ		ロ		ハ		ニ		ホ	ヘ
		CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額		リスク・ウェイトの加重平均値 (RWA density)			
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額						
1	現金	1	—	1	—	—	—	—	—		
2	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
4	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	100	—	100	—	20	20.00%				
12	法人等向け	1,527	—	1,527	—	1,527	100.00%				
13	中小企業等向け及び個人向け	4,694	—	4,694	—	3,521	75.00%				
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—				
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—				
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	114	—	114	—	123	107.89%				
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—				
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—				
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—				
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—				
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—				
22	合計	6,437	—	6,437	—	5,192	80.64%				

CR5：標準的手法 - 資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	リスク・ウェイト 資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)										
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1,250%	合計
1	現金	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1
2	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	122	—	—	—	—	—	—	—	122
12	法人等向け	—	—	—	—	—	—	1,417	—	—	—	1,417
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	4,264	—	—	—	—	4,264
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	30	—	288	14	—	—	333
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
22	合計	1	—	122	—	30	4,264	1,706	14	—	—	6,140

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	リスク・ウェイト 資産クラス	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		信用リスク・エクスポージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)										
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1,250%	合計
1	現金	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1
2	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	100	—	—	—	—	—	—	—	100
12	法人等向け	—	—	—	—	—	—	1,527	—	—	—	1,527
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	4,694	—	—	—	—	4,694
14	抵当権付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	不動産取得等事業向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	—	—	—	—	—	—	96	18	—	—	114
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
18	取立未済手形	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
19	信用保証協会等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
21	出資等(重要な出資を除く。)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
22	合計	1	—	100	—	—	4,694	1,623	18	—	—	6,437

CR6：内部格付手法 - ポートフォリオ及びデフォルト率(PD)区分別の信用リスク・エクスポージャー

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	ロ CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・ 信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者 の数	ト 平均LGD	チ 平均残存 期間	リ 信用 リスク・ アセット の額	ヌ リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	ル EL	ヲ 適格 引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	2,402,753	93,472	0.01%	2,525,865	0.00%	2.7	45.00%	4.64	76,799	3.04%	64	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	638	—	—	638	0.34%	0.0	45.00%	1.84	325	50.92%	0	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	54	23	—	54	2.30%	0.0	45.00%	4.99	100	186.55%	0	
6	2.50%以上10.00%未満	1,216	—	—	1,216	6.51%	0.0	45.00%	1.00	1,783	146.66%	35	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	2,404,661	93,495	0.01%	2,527,774	0.00%	2.7	45.00%	4.63	79,009	3.12%	101	56
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	85,974	—	—	85,974	0.04%	0.0	45.00%	2.85	21,996	25.58%	16	
2	0.15%以上0.25%未満	300	—	—	300	0.19%	0.0	45.00%	1.47	100	33.34%	0	
3	0.25%以上0.50%未満	500	—	—	500	0.34%	0.0	45.00%	4.00	370	74.00%	0	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	160	500	—	160	1.53%	0.0	45.00%	4.00	200	125.50%	1	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	86,934	500	—	86,934	0.04%	0.0	45.00%	2.85	22,667	26.07%	18	16
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	909,849	463,484	11.12%	955,761	0.06%	0.7	46.67%	2.77	264,438	27.66%	303	
2	0.15%以上0.25%未満	166,284	85,198	10.38%	171,339	0.19%	0.3	44.34%	2.77	77,313	45.12%	143	
3	0.25%以上0.50%未満	147,655	43,844	17.78%	150,447	0.34%	0.3	43.77%	3.06	94,264	62.65%	223	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	169,956	49,787	11.92%	170,388	1.34%	0.4	43.90%	3.06	179,845	105.55%	1,006	
6	2.50%以上10.00%未満	49,282	9,037	9.90%	47,976	4.99%	0.2	43.51%	2.42	68,733	143.26%	1,040	
7	10.00%以上100.00%未満	11,636	233	33.22%	11,179	11.86%	0.0	43.84%	2.55	22,435	200.68%	581	
8	100.00%(デフォルト)	19,850	3,165	33.83%	21,484	100.00%	0.0	44.41%	1.00	—	—	9,542	
9	小計	1,474,516	654,751	11.63%	1,528,577	1.89%	2.2	45.66%	2.80	707,029	46.25%	12,842	8,785
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	65,836	40,207	4.49%	58,548	0.10%	0.5	43.22%	3.49	18,556	31.69%	26	
2	0.15%以上0.25%未満	160,847	37,474	3.97%	141,341	0.19%	1.2	41.74%	4.16	62,502	44.22%	112	
3	0.25%以上0.50%未満	158,618	14,129	4.33%	141,391	0.34%	1.1	41.81%	4.33	83,894	59.33%	201	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	272,736	22,350	12.80%	241,035	1.35%	1.9	42.20%	4.09	220,353	91.41%	1,384	
6	2.50%以上10.00%未満	146,202	6,162	16.42%	112,576	5.33%	1.0	42.39%	3.72	143,186	127.19%	2,561	
7	10.00%以上100.00%未満	27,405	289	10.04%	19,208	11.86%	0.2	42.57%	3.86	31,878	165.95%	970	
8	100.00%(デフォルト)	47,917	1,664	9.44%	47,075	100.00%	0.3	44.09%	1.00	—	—	20,758	
9	小計	879,565	122,278	6.51%	761,176	7.81%	6.5	42.27%	3.85	560,370	73.61%	26,013	26,735
株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるものに限る)													
1	0.00%以上0.15%未満	263,545	—	—	263,545	0.05%	0.1	90.00%	5.00	288,401	109.43%	—	
2	0.15%以上0.25%未満	1,698	—	—	1,698	0.19%	0.0	90.00%	5.00	2,380	140.12%	—	
3	0.25%以上0.50%未満	1,068	—	—	1,068	0.34%	0.0	90.00%	5.00	1,889	176.85%	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	1,434	—	—	1,434	1.28%	0.0	90.00%	5.00	3,994	278.33%	—	
6	2.50%以上10.00%未満	573	—	—	573	4.92%	0.0	90.00%	5.00	2,709	472.26%	—	
7	10.00%以上100.00%未満	0	—	—	0	11.86%	0.0	90.00%	5.00	0	592.00%	—	
8	100.00%(デフォルト)	1	—	—	1	100.00%	0.0	90.00%	1.00	16	1,125.00%	—	
9	小計	268,323	—	—	268,323	0.06%	0.2	90.00%	4.99	299,392	111.57%	—	—

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	ロ CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者 の数	ト 平均LGD	チ 平均残存 期間	リ 信用 リスク・ アセット の額	ヌ リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	ル EL	ラ 適格 引当金
購入債権(事業法人等向け)に係る債務者のデフォルト・リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	14,267	—	—	14,267	0.07%	0.0	45.00%	4.02	4,862	34.08%	4	
2	0.15%以上0.25%未満	498	—	—	498	0.19%	0.0	45.00%	5.00	325	65.43%	0	
3	0.25%以上0.50%未満	291	—	—	291	0.34%	0.0	45.00%	2.30	188	64.89%	0	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	2,828	—	—	2,828	1.81%	0.0	56.01%	1.89	3,756	132.81%	30	
6	2.50%以上10.00%未満	1,422	—	—	1,422	4.13%	0.0	45.00%	4.32	2,319	162.98%	26	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	19,307	—	—	19,307	0.63%	0.0	46.61%	3.73	11,452	59.31%	62	44
購入債権(事業法人等向け)に係る希薄化リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	19,695	—	—	19,695	0.03%	0.0	100.00%	1.00	4,763	24.18%	6	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	19,695	—	—	19,695	0.03%	0.0	100.00%	1.00	4,763	24.18%	6	—
購入債権(事業法人等向け)に係る原債権者のデフォルト・リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	1,706	—	—	1,706	0.03%	0.0	45.00%	2.51	337	19.77%	0	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	1,706	—	—	1,706	0.03%	0.0	45.00%	2.51	337	19.77%	0	—
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	—	71,117	45.46%	32,332	0.11%	211.4	100.00%		2,166	6.70%	36	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	3,807	28,041	45.59%	16,580	1.34%	105.1	100.00%		7,951	47.95%	223	
6	2.50%以上10.00%未満	12,354	6,505	45.24%	15,242	4.06%	24.3	100.00%		16,136	105.86%	618	
7	10.00%以上100.00%未満	126	81	45.37%	162	39.94%	0.3	100.00%		493	303.66%	64	
8	100.00%(デフォルト)	435	106	—	435	100.00%	2.7	100.00%		—	—	435	
9	小計	16,723	105,852	45.43%	64,752	2.12%	344.0	100.00%		26,747	41.30%	1,379	432
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
2	0.15%以上0.25%未満	421,345	—	—	420,948	0.21%	18.6	40.56%		71,057	16.88%	358	
3	0.25%以上0.50%未満	494,729	—	—	493,254	0.35%	39.7	40.85%		123,854	25.10%	724	
4	0.50%以上0.75%未満	9,773	—	—	9,701	0.63%	1.6	46.28%		4,129	42.56%	28	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	7,489	—	—	7,481	16.75%	0.6	42.72%		17,259	230.69%	537	
8	100.00%(デフォルト)	3,034	—	—	3,176	100.00%	0.2	43.17%		—	—	1,371	
9	小計	936,372	—	—	934,562	0.76%	60.8	40.80%		216,302	23.14%	3,020	2,039

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	ロ CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・ 信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者 の数	ト 平均LGD	チ 平均残存 期間	リ 信用 リスク・ アセット の額	ヌ リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	ル EL	ロ 適格 引当金
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	59,898	7,099	91.60%	65,038	0.07%	7.4	88.98%		11,174	17.18%	42	
2	0.15%以上0.25%未満	13,203	321	31.26%	13,156	0.19%	2.1	97.27%		5,005	38.04%	24	
3	0.25%以上0.50%未満	68,121	879	73.16%	68,082	0.30%	4.7	58.68%		22,191	32.59%	132	
4	0.50%以上0.75%未満	18,409	0	100.00%	18,225	0.53%	5.1	61.45%		8,321	45.65%	59	
5	0.75%以上2.50%未満	41,781	1,442	57.25%	42,297	1.50%	18.4	87.01%		42,253	99.89%	545	
6	2.50%以上10.00%未満	5,487	321	79.73%	5,663	3.60%	0.8	68.28%		5,525	97.57%	141	
7	10.00%以上100.00%未満	678	50	85.80%	721	16.84%	0.1	61.64%		923	127.98%	77	
8	100.00%(デフォルト)	5,144	17	—	6,108	100.00%	0.9	84.86%		—	—	5,171	
9	小計	212,725	10,132	82.63%	219,294	3.39%	39.8	76.66%		95,395	43.50%	6,194	1,508
	合計(全てのポートフォリオ)	6,299,518	987,010	14.24%	6,411,091	1.63%	456.7	47.75%	3.96	2,023,468	31.56%	49,639	39,619

- (注1) 当行は、特定貸付債権に対してスロットティング・クライテリア方式を適用していること、また購入債権(リテール)は保有していないことから、本表には記載しておりません。
- (注2) 「購入債権(事業法人等向け)に係る希薄化リスク相当部分」については、リスク・アセット計算上、Eldilutionではなく原債権者PDを使用しており、当該原債権者のPD区分にもとづき記載しております。
- (注3) 適格リボルビング型リテール、居住用不動産、その他リテール向けエクスポージャーは、ヘ欄「債務者の数」に債権の数を開示しております(債権単位でPD推計を行っているため)。
- (注4) イ・ロ・ニ欄において、各ポートフォリオの小計の合計値は、合計(すべてのポートフォリオ)欄記載の数値とは一致しないことがあります(購入債権ポートフォリオを細分化しているため)。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ラ
		オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	平均CCF	CCF・信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	平均PD	債務者 の数	平均LGD	平均残存 期間	信用 リスク・ アセット の額	リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	EL	適格 引当金
ソブリン向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	2,038,685	93,631	0.01%	2,095,842	0.00%	1.8	45.00%	4.3	61,981	2.95%	57	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	711	—	—	711	0.32%	0.0	45.00%	1.7	341	47.99%	1	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	54	22	—	54	2.35%	0.0	45.00%	4.9	102	186.75%	0	
6	2.50%以上10.00%未満	1,255	—	—	1,255	6.70%	0.0	45.00%	1.0	1,863	148.43%	37	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	2,040,706	93,654	0.01%	2,097,863	0.01%	1.8	45.00%	4.3	64,287	3.06%	97	74
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	99,012	—	—	99,012	0.04%	0.0	45.00%	2.5	23,006	23.23%	18	
2	0.15%以上0.25%未満	300	—	—	300	0.16%	0.0	45.00%	2.4	115	38.60%	0	
3	0.25%以上0.50%未満	700	—	—	700	0.32%	0.0	45.00%	4.9	577	82.55%	1	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	—	500	—	—	—	0.0	—	—	—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	100,012	500	—	100,012	0.04%	0.0	45.00%	2.5	23,700	23.69%	20	14
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	856,323	447,966	9.50%	892,827	0.06%	0.8	46.21%	2.7	247,224	27.69%	284	
2	0.15%以上0.25%未満	173,066	66,275	7.31%	174,075	0.16%	0.3	44.37%	2.7	71,256	40.93%	123	
3	0.25%以上0.50%未満	124,081	35,990	14.12%	126,304	0.32%	0.2	43.80%	3.0	76,818	60.82%	177	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	183,507	50,775	10.14%	184,020	1.42%	0.4	43.65%	2.9	193,022	104.89%	1,145	
6	2.50%以上10.00%未満	36,037	6,155	20.03%	35,929	5.31%	0.2	43.62%	2.3	52,634	146.49%	832	
7	10.00%以上100.00%未満	13,461	327	63.59%	13,222	12.28%	0.0	43.80%	2.4	26,679	201.76%	711	
8	100.00%(デフォルト)	13,333	1,589	24.44%	14,529	100.00%	0.0	44.34%	1.0	—	—	6,443	
9	小計	1,399,813	609,080	9.77%	1,440,909	1.52%	2.2	45.35%	2.7	667,636	46.33%	9,718	7,437
中堅中小企業向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	68,183	38,197	5.70%	62,472	0.11%	0.5	43.36%	3.3	19,824	31.73%	31	
2	0.15%以上0.25%未満	143,824	27,008	3.34%	135,734	0.16%	1.0	41.73%	4.0	53,451	39.37%	90	
3	0.25%以上0.50%未満	145,927	12,472	4.82%	137,357	0.32%	1.0	41.89%	4.1	77,234	56.22%	184	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	249,445	15,960	22.78%	237,608	1.39%	1.9	42.11%	4.1	218,869	92.11%	1,396	
6	2.50%以上10.00%未満	132,585	4,655	8.84%	113,092	5.53%	0.9	42.33%	3.6	144,886	128.11%	2,659	
7	10.00%以上100.00%未満	24,386	220	26.08%	18,878	12.28%	0.2	43.50%	3.8	32,600	172.68%	1,008	
8	100.00%(デフォルト)	39,573	1,347	14.41%	40,406	100.00%	0.2	44.32%	1.0	—	—	17,909	
9	小計	803,926	99,862	7.99%	745,549	7.11%	6.1	42.29%	3.8	546,866	73.35%	23,280	26,039
株式等エクスポージャー(PD/LGD方式が適用されるものに限る)													
1	0.00%以上0.15%未満	225,705	—	—	225,705	0.04%	0.1	90.00%	5.0	246,841	109.36%	—	
2	0.15%以上0.25%未満	1,884	—	—	1,884	0.16%	0.0	90.00%	5.0	2,423	128.57%	—	
3	0.25%以上0.50%未満	1,117	—	—	1,117	0.32%	0.0	90.00%	5.0	2,126	190.24%	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	1,005	—	—	1,005	1.72%	0.0	90.00%	5.0	3,111	309.31%	—	
6	2.50%以上10.00%未満	403	—	—	403	4.85%	0.0	90.00%	5.0	1,642	406.97%	—	
7	10.00%以上100.00%未満	0	—	—	0	12.28%	0.0	90.00%	5.0	0	334.50%	—	
8	100.00%(デフォルト)	1	—	—	1	100.00%	0.0	90.00%	1.0	16	1,125.00%	—	
9	小計	230,118	—	—	230,118	0.06%	0.2	90.00%	4.9	256,161	111.31%	—	—

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	ロ CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・ 信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者 の数	ト 平均LGD	チ 平均残存 期間	リ 信用 リスク・ アセット の額	ヌ リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	ル EL	ロ 適格 引当金
購入債権(事業法人等向け)に係る債務者のデフォルト・リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	8,541	—	—	8,541	0.06%	0.0	45.00%	3.7	2,457	28.77%	2	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	1,177	—	—	1,177	0.32%	0.0	45.00%	1.3	686	58.26%	1	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	1,059	—	—	1,059	2.36%	0.0	75.00%	1.6	1,939	183.11%	18	
6	2.50%以上10.00%未満	767	—	—	767	6.70%	0.0	45.00%	5.0	1,501	195.66%	23	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	11,545	—	—	11,545	0.74%	0.0	47.75%	3.3	6,584	57.03%	45	28
購入債権(事業法人等向け)に係る希薄化リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	11,786	—	—	11,786	0.03%	0.0	100.00%	1.0	2,961	25.12%	4	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	11,786	—	—	11,786	0.03%	0.0	100.00%	1.0	2,961	25.12%	4	—
購入債権(事業法人等向け)に係る原債権者のデフォルト・リスク相当部分													
1	0.00%以上0.15%未満	1,861	—	—	1,861	0.03%	0.0	45.00%	3.0	432	23.22%	0	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	1,861	—	—	1,861	0.03%	0.0	45.00%	3.0	432	23.22%	0	—
適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	0	69,594	44.95%	31,282	0.12%	208.7	100.00%		2,191	7.00%	37	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	4,169	27,465	44.88%	16,478	1.36%	104.9	100.00%		7,971	48.37%	224	
6	2.50%以上10.00%未満	13,030	6,711	45.06%	15,989	4.17%	26.6	100.00%		17,235	107.79%	666	
7	10.00%以上100.00%未満	141	75	44.99%	174	40.58%	0.3	100.00%		529	303.09%	70	
8	100.00%(デフォルト)	416	93	—	416	100.00%	2.6	100.00%		—	—	416	
9	小計	17,758	103,939	44.89%	64,342	2.20%	343.2	100.00%		27,927	43.40%	1,416	470
居住用不動産向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
2	0.15%以上0.25%未満	413,157	—	—	412,782	0.21%	18.8	41.07%		70,543	17.08%	356	
3	0.25%以上0.50%未満	455,840	—	—	454,381	0.36%	37.4	41.37%		116,398	25.61%	682	
4	0.50%以上0.75%未満	30,169	—	—	30,055	0.56%	2.9	43.41%		11,062	36.80%	73	
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—		—	—	—	
7	10.00%以上100.00%未満	6,984	—	—	6,977	17.62%	0.5	43.41%		16,564	237.38%	535	
8	100.00%(デフォルト)	3,120	—	—	3,300	100.00%	0.3	43.71%		—	—	1,442	
9	小計	909,272	—	—	907,498	0.79%	60.0	41.33%		214,569	23.64%	3,090	2,155

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ オン・ バランス シート・ グロス エクスポ ージャーの額	ロ CCF・信用 リスク削減 手法適用前 のオフ・ バランス シート・ エクスポ ージャーの額	ハ 平均CCF	ニ CCF・ 信用 リスク 削減手法 適用後 EAD	ホ 平均PD	ヘ 債務者 の数	ト 平均LGD	チ 平均残存 期間	リ 信用 リスク・ アセット の額	ヌ リスク・ ウェイト の加重平 均値 (RWA density)	ル EL	ラ 適格 引当金
その他リテール向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	57,358	8,119	89.90%	47,924	0.09%	6.8	82.52%		8,861	18.49%	34	
2	0.15%以上0.25%未満	11,508	394	32.25%	11,442	0.19%	2.1	96.91%		4,336	37.90%	21	
3	0.25%以上0.50%未満	61,214	868	82.65%	61,270	0.28%	3.4	52.65%		16,555	27.02%	93	
4	0.50%以上0.75%未満	31,717	128	29.64%	31,485	0.52%	7.2	74.31%		17,243	54.76%	122	
5	0.75%以上2.50%未満	41,593	1,342	56.28%	42,005	1.44%	18.6	88.09%		42,161	100.37%	526	
6	2.50%以上10.00%未満	6,651	353	80.26%	6,839	3.71%	1.0	69.54%		6,820	99.72%	180	
7	10.00%以上100.00%未満	611	0	45.05%	607	18.63%	0.1	65.82%		864	142.35%	76	
8	100.00% (デフォルト)	5,538	5	—	6,722	100.00%	1.0	85.59%		—	—	5,754	
9	小計	216,194	11,212	82.24%	208,298	3.88%	40.6	74.03%		96,843	46.49%	6,809	1,803
	合計(全てのポートフォリオ)	5,729,589	918,248	13.43%	5,806,378	1.58%	454.5	47.60%	3.7	1,907,971	32.85%	44,482	38,024

- (注1) 当行は、特定貸付債権に対してスロットティング・クライテリア方式を適用していること、また購入債権(リテール)は保有していないことから、本表には記載しておりません。
- (注2) 「購入債権(事業法人等向け)に係る希薄化リスク相当部分」については、リスク・アセット計算上、EL dilutionではなく原債権者PDを使用しており、当該原債権者のPD区分にもとづき記載しております。
- (注3) 適格リボルビング型リテール、居住用不動産、その他リテール向けエクスポージャーは、ヘ欄「債務者の数」に債権の数を開示しております(債権単位でPD推計を行っているため)。
- (注4) イ・ロ・ニ欄において、各ポートフォリオの小計の合計値は、合計(すべてのポートフォリオ)欄記載の数値とは一致しないことがあります(購入債権ポートフォリオを細分化しているため)。

CR7：内部格付手法 - 信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ勘案前の 信用リスク・アセットの額	実際の信用リスク・アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー - FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー - AIRB	—	—
3	金融機関等向けエクスポージャー - FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー - AIRB	—	—
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) - FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) - AIRB	—	—
7	特定貸付債権 - FIRB	—	—
8	特定貸付債権 - AIRB	—	—
9	リテール - 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール - 居住用不動産向けエクスポージャー	—	—
11	リテール - その他リテール向けエクスポージャー	—	—
12	株式 - FIRB	—	—
13	株式 - AIRB	—	—
14	購入債権 - FIRB	—	—
15	購入債権 - AIRB	—	—
16	合計	—	—

(注) 当行では、信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブを用いておりません。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	ポートフォリオ	イ	ロ
		クレジット・デリバティブ勘案前の 信用リスク・アセットの額	実際の信用リスク・アセットの額
1	ソブリン向けエクスポージャー - FIRB	—	—
2	ソブリン向けエクスポージャー - AIRB	—	—
3	金融機関等向けエクスポージャー - FIRB	—	—
4	金融機関等向けエクスポージャー - AIRB	—	—
5	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) - FIRB	—	—
6	事業法人向けエクスポージャー(特定貸付債権を除く。) - AIRB	—	—
7	特定貸付債権 - FIRB	—	—
8	特定貸付債権 - AIRB	—	—
9	リテール - 適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー	—	—
10	リテール - 居住用不動産向けエクスポージャー	—	—
11	リテール - その他リテール向けエクスポージャー	—	—
12	株式 - FIRB	—	—
13	株式 - AIRB	—	—
14	購入債権 - FIRB	—	—
15	購入債権 - AIRB	—	—
16	合計	—	—

(注) 当行では、信用リスク削減手法としてクレジット・デリバティブを用いておりません。

CR10：内部格付手法 - 特定貸付債権(スロットティング・クライテリア方式)と株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
特定貸付債権(スロットティング・クライテリア方式)											
ポラティリティの高い事業用不動産向け貸付(HVCRE)以外											
規制上の区分	残存期間	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額(EAD)					信用リスク・ アセットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	545	—	70%	545	—	—	—	545	381	2
	2.5年以上	1,746	—	90%	1,641	—	—	105	1,746	1,571	13
可(Satisfactory)		12,287	8,213	115%	19,651	848	—	—	20,500	23,575	574
弱い(Weak)		6,479	156	250%	5,591	1,043	—	—	6,635	16,587	530
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		21,058	8,369	—	27,429	1,892	—	105	29,427	42,116	1,120
ポラティリティの高い事業用不動産向け貸付(HVCRE)											
規制上の区分	残存期間	オン・バランス シート額	オフ・バランス シート額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額 (EAD)					信用リスク・ アセットの額	期待損失
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%						—	—
	2.5年以上	—	—	95%						—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%						—	—
	2.5年以上	—	—	120%						—	—
可(Satisfactory)		—	—	140%						—	—
弱い(Weak)		3,241	—	250%						3,241	8,102
デフォルト(Default)		—	—	—						—	—
合計		3,241	—	—						3,241	8,102
株式等エクスポージャー(マーケット・ベース方式等)											
マーケット・ベース方式が適用される株式等エクスポージャー											
カテゴリー	オン・バランス シート額	オフ・バランス シート額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額 (EAD)					信用リスク・ アセットの額	期待損失	
簡易手法 - 上場株式	3,777	—	300%						3,777	11,332	
簡易手法 - 非上場株式	1,115	7	400%						1,122	4,490	
内部モデル手法	—	—	—						—	—	
合計	4,892	7	—						4,899	15,822	
100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー											
自己資本比率告示第166条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	23	—	100%						23	23	

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

規制上の区分	残存期間	オン・バランス シートの額	オフ・バランス シートの額	リスク・ ウェイト	エクスポージャーの額(EAD)				信用リスク・ アセットの額	期待損失
					PF	OF	CF	IPRE		
特定貸付債権(スロッシング・クライテリア方式)										
ボラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(HVCRE)以外										
優(Strong)	2.5年未満	—	—	50%	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	—	—	70%	—	—	—	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	1,597	—	90%	1,476	—	—	120	1,597	1,437
可(Satisfactory)		15,783	5,593	115%	19,643	1,733	—	—	21,376	24,583
弱い(Weak)		555	964	250%	1,146	374	—	—	1,520	3,801
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		17,936	6,558	—	22,266	2,107	—	120	24,494	29,822

規制上の区分	残存期間	オン・バランス シート額	オフ・バランス シート額	リスク・ ウェイト	エクスポー ジャーの額 (EAD)	信用リスク・ アセットの額	期待損失
優(Strong)	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—
	2.5年以上	—	—	95%	—	—	—
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%	—	—	—
	2.5年以上	—	—	120%	—	—	—
可(Satisfactory)		—	—	140%	—	—	—
弱い(Weak)		1,290	—	250%	1,290	3,227	103
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—
合計		1,290	—	—	1,290	3,227	103

カテゴリー	オン・バランス シート額	オフ・バランス シート額	リスク・ ウェイト	エクスポー ジャーの額 (EAD)	信用リスク・ アセットの額
簡易手法 - 上場株式	4,828	—	300%	4,828	14,484
簡易手法 - 非上場株式	1,115	—	400%	1,115	4,460
内部モデル手法	—	—	—	—	—
合計	5,943	—	—	5,943	18,944

100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー							
自己資本比率告示第166条第1項ただし書の定めるところにより100%のリスク・ウェイトが適用される株式等エクスポージャー	27	—	100%	27	27	—	—

CCR1：手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
1 SA-CCR	—	—	—	—	1.4	—
カレント・エクスポージャー方式	5,324	9,300	—	—	14,624	5,950
2 期待エクスポージャー方式	—	—	—	—	—	—
3 信用リスク削減手法における簡便手法	—	—	—	—	—	—
4 信用リスク削減手法における包括的手法	—	—	—	—	954,670	797
5 エクスポージャー変動推計モデル	—	—	—	—	—	—
6 合計	—	—	—	—	—	6,747

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
1 SA-CCR	—	—	—	—	1.4	—
カレント・エクスポージャー方式	3,104	7,301	—	—	10,406	3,461
2 期待エクスポージャー方式	—	—	—	—	—	—
3 信用リスク削減手法における簡便手法	—	—	—	—	—	—
4 信用リスク削減手法における包括的手法	—	—	—	—	632,300	670
5 エクスポージャー変動推計モデル	—	—	—	—	—	—
6 合計	—	—	—	—	—	4,131

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後の エクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	—	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	—	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	14,623	14,086
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計額	14,623	14,086

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後の エクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	—	—
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	—	—
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	—	—
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	10,405	6,699
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計額	10,405	6,699

CCR3：業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減手法勘案後)								合計
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	
			0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	
1	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
14	合計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注)当行では、標準的手法を適用するカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーはありません。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減手法勘案後)								合計
			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	
			0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	
1	日本国政府及び日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	国際決済銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	我が国の地方公共団体向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	国際開発銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	地方公共団体金融機構向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	我が国の政府関係機関向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	上記以外	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
14	合計	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注)当行では、標準的手法を適用するカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーはありません。

CCR4：内部格付手法 - ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ EAD(信用リスク 削減手法助案後)	ロ 平均PD	ハ 取引相手方 の数	ニ 平均LGD	ホ 平均残存 期間	ヘ 信用リスク・ アセット	ト リスク・ウェイトの 加重平均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	734,990	—	0.0	45.00%	5.00	—	—
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	734,990	—	0.0	45.00%	5.00	—	—
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	65,388	0.04%	0.0	8.65%	0.64	3,290	5.03%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	65,388	0.04%	0.0	8.65%	0.64	3,290	5.03%
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャーを含む)								
1	0.00%以上0.15%未満	166,280	0.09%	0.0	1.60%	0.04	1,102	0.66%
2	0.15%以上0.25%未満	719	0.19%	0.0	45.00%	3.04	303	42.21%
3	0.25%以上0.50%未満	501	0.34%	0.0	44.96%	2.30	268	53.58%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	1,313	1.84%	0.0	45.00%	4.10	1,672	127.37%
6	2.50%以上10.00%未満	98	4.47%	0.0	44.80%	2.05	107	109.49%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	0	100.00%	0.0	45.00%	1.00	—	—
9	小計	168,913	0.10%	0.1	2.28%	0.09	3,456	2.04%
その他リテール向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	1	0.11%	0.0	87.62%	—	0	23.29%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	0	0.36%	0.0	87.62%	—	0	51.92%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	0	1.33%	0.0	87.62%	—	0	99.72%
6	2.50%以上10.00%未満	0	3.46%	0.0	47.71%	—	0	67.84%
7	10.00%以上100.00%未満	0	14.56%	0.0	47.71%	—	0	92.72%
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	1	1.22%	0.0	83.80%	—	0	35.47%
合計(全てのポートフォリオ)		969,294	0.02%	0.1	35.10%	3.85	6,747	0.69%

(2019年度中間期末)

(単位 百万円、千件・年)

項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD(信用リスク削減手法勘案後)	平均PD	取引相手方の数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・アセット	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	444,586	—	0.0	45.00%	5.0	—	—
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	444,586	—	0.0	45.00%	5.0	—	—
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	66,119	0.05%	0.0	6.52%	0.4	2,168	3.27%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
6	2.50%以上10.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	66,119	0.05%	0.0	6.52%	0.4	2,168	3.27%
事業法人向けエクスポージャー(中堅中小企業向けエクスポージャーを含む)								
1	0.00%以上0.15%未満	130,401	0.09%	0.0	1.66%	0.0	879	0.67%
2	0.15%以上0.25%未満	564	0.16%	0.0	45.00%	2.8	216	38.44%
3	0.25%以上0.50%未満	342	0.32%	0.0	45.00%	1.6	151	44.11%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	594	1.42%	0.0	44.94%	3.0	616	103.68%
6	2.50%以上10.00%未満	88	4.35%	0.0	45.00%	2.2	98	110.95%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	2	100.00%	0.0	45.00%	1.0	—	—
9	小計	131,993	0.10%	0.1	2.18%	0.0	1,961	1.48%
その他テール向けエクスポージャー								
1	0.00%以上0.15%未満	6	0.11%	0.0	58.63%	—	0	15.59%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	0	0.38%	0.0	79.21%	—	0	48.51%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	0	1.34%	0.0	87.87%	—	0	100.27%
6	2.50%以上10.00%未満	0	3.52%	0.0	62.93%	—	0	89.67%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	7	0.18%	0.0	61.05%	—	1	21.34%
合計(全てのポートフォリオ)		642,706	0.02%	0.1	32.24%	3.5	4,131	0.64%

CCR5：担保の内訳

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金(国内通貨)	—	—	—	—	165,012	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	53,955	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	—
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	—
6	社債	—	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	218,967	—

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金(国内通貨)	—	—	—	—	129,222	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	57,890	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	—
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	—
6	社債	—	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	187,112	—

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ		ロ	
		購入したプロテクション		提供したプロテクション	
	想定元本				
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—	—	—
4	クレジットオプション	—	—	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—	—	—
6	想定元本合計	—	—	—	—
	公正価値				
7	プラスの公正価値(資産)	—	—	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—	—	—

(注)当行は、クレジット・デリバティブ取引を行っておりません。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ		ロ	
		購入したプロテクション		提供したプロテクション	
	想定元本				
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—	—	—
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	—	—	—	—
3	トータル・リターン・スワップ	—	—	—	—
4	クレジットオプション	—	—	—	—
5	その他のクレジット・デリバティブ	—	—	—	—
6	想定元本合計	—	—	—	—
	公正価値				
7	プラスの公正価値(資産)	—	—	—	—
8	マイナスの公正価値(負債)	—	—	—	—

(注)当行は、クレジット・デリバティブ取引を行っておりません。

CCR8：中央清算機関向けエクスポージャー

連結
(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		14
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	372	14
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
4	(ii) 派生商品取引(上場)	372	14
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	—	—
8	分別管理されていない当初証拠金	—	—
9	事前拠出された清算基金	—	—
10	未拠出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レポ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	—
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拠出された清算基金	—	—
20	未拠出の清算基金	—	—

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ
		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		20
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く。)	515	20
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
4	(ii) 派生商品取引(上場)	515	20
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	—	—
8	分別管理されていない当初証拠金	—	—
9	事前拠出された清算基金	—	—
10	未拠出の清算基金	—	—
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		—
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー(当初証拠金を除く)	—	—
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
14	(ii) 派生商品取引(上場)	—	—
15	(iii) レポ形式の取引	—	—
16	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
17	分別管理されている当初証拠金	—	—
18	分別管理されていない当初証拠金	—	—
19	事前拠出された清算基金	—	—
20	未拠出の清算基金	—	—

SEC1：原資産の種類別の証券化エクスポージャー(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に限る。)

連結
(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	原資産の種類	イ			ロ			ハ			ニ			ホ			ヘ			ト			チ			リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家			資産譲渡型			合成型			資産譲渡型			合成型			資産譲渡型			合成型		
		資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計			
1	リテール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	143,790	—	—	143,790	—	—	—		
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	143,790	—	—	143,790	—	—	—		
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
9	リース債権および売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	原資産の種類	イ ロ ハ			ニ ホ ヘ			ト チ リ		
		自金融機関がオリジネーター			自金融機関がスポンサー			自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計	資産譲渡型 証券化 取引	合成型 証券化 取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—	—	—	—	141,587	—	141,587
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	141,587	—	141,587
3	クレジットカード債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権および売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

SEC2：原資産の種類別の証券化エクスポージャー(マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。)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。

SEC3：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本
(自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合)

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	カ	ヨ	
		合計	資産譲渡型証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるリテール	ホールセール	再証券化	シニア	非シニア	合成型証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるリテール	ホールセール	再証券化	シニア	非シニア
			エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)													
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
エクスポージャーの額(算出方法別)																
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
信用リスク・アセットの額(算出方法別)																
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
13	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
所要自己資本の額(算出方法別)																
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
17	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	

(注)当行がオリジネーター又はスポンサーである証券化エクスポージャーはありません。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ
		合計	資産 譲渡型 証券化 取引 (小計)	証券化	裏付け となる リテール	ホール セール	再 証券化	シニア	非 シニア	合成型 証券化 取引 (小計)	証券化	裏付け となる リテール	ホール セール	再 証券化	シニア	非 シニア
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)																
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)																
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)																
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)																
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注) 当行がオリジネーター又はスポンサーである証券化エクスポージャーはありません。

SEC4：信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本
(自金融機関が投資家である場合)

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	ワ	カ	ヨ
		合計	資産 譲渡型 証券化 取引 (小計)	証券化	裏付け となる リテール	ホール セール	再 証券化	シニア	非 シニア	合成型 証券化 取引 (小計)	証券化	裏付け となる リテール	ホール セール	再 証券化	シニア	非 シニア
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)																
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	150,727	146,291	146,291	143,790	2,500	—	—	—	4,436	4,436	—	4,436	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)																
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	150,727	146,291	146,291	143,790	2,500	—	—	—	4,436	4,436	—	4,436	—	—	
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)																
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	30,071	29,258	29,258	28,758	500	—	—	—	813	813	—	813	—	—	
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)																
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	2,405	2,340	2,340	2,300	40	—	—	—	65	65	—	65	—	—	
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		合計	資産												
			認識渡型証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるリテール	ホールセール	再証券化	シニア	非シニア	合成型証券化取引(小計)	証券化	裏付けとなるリテール	ホールセール	再証券化	シニア
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)															
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	141,587	141,587	141,587	141,587	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	100%超1,250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
エクスポージャーの額(算出方法別)															
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	141,587	141,587	141,587	141,587	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信用リスク・アセットの額(算出方法別)															
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	28,317	28,317	28,317	28,317	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
所要自己資本の額(算出方法別)															
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	2,265	2,265	2,265	2,265	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	1,250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

MR1：標準的方式によるマーケット・リスク相当額

MR3：内部モデル方式の状況(マーケット・リスク)

MR4：内部モデル方式のバック・テストの結果

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。

IRRBB 1：金利リスク

連結

(単位 百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		△EVE		△NII		△EVE		△NII	
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	上方パラレルシフト	31,957	29,896	670	1,449				
2	下方パラレルシフト	0	0	4,247	7,047				
3	スティープ化	18,294	16,012						
4	フラット化	631	111						
5	短期金利上昇	5,287	5,173						
6	短期金利低下	1	0						
7	最大値	31,957	29,896	4,247	7,047				
		ホ		ハ					
		2020年度中間期		2019年度中間期					
8	Tier1 資本の額	416,807		397,027					

単体

(単位 百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		△EVE		△NII		△EVE		△NII	
		2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期	2020年度中間期	2019年度中間期
1	上方パラレルシフト	31,957	29,896	670	1,449				
2	下方パラレルシフト	0	0	4,247	7,047				
3	スティープ化	18,294	16,012						
4	フラット化	631	111						
5	短期金利上昇	5,287	5,173						
6	短期金利低下	1	0						
7	最大値	31,957	29,896	4,247	7,047				
		ホ		ハ					
		2020年度中間期		2019年度中間期					
8	Tier1 資本の額	403,539		381,711					

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

連結

(2020年度中間期末)

(単位 百万円)

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
香港	1.00%	1,053		
ルクセンブルク	0.25%	1		
小計		1,055		
合計		2,364,944	0.00%	—

(注)原則最終リスク国ベースで算出しております。

(2019年度中間期末)

(単位 百万円)

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
フランス	0.25%	1,356		
香港	2.50%	2,241		
英国	1.00%	1,506		
小計		3,748		
合計		2,194,853	0.00%	—

(注)原則最終リスク国ベースで算出しております。