

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または信用リスク・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)	
		2022年度中間期	2021年度中間期
ルックスルー方式	(告示第167条第2項)	117,551	86,910
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)	—	1,003
フォールバック方式	(告示第167条第11項)	790	862
合計		118,341	88,776

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		イ リスク・アセット		ハ 所要自己資本	
		2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期
1	信用リスク	2,326,445	2,337,422	196,861	197,806
2	うち、標準的手法適用分	5,543	5,257	443	420
3	うち、内部格付手法適用分	2,238,634	2,252,701	189,836	191,029
	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	79,463	6,581	6,357
4	カウンターパーティ信用リスク	85,709	37,718	6,980	3,099
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	7,384	1,285	626
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	20,576	4,780	1,646
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	147	10	11	—
	その他	10,653	9,746	903	826
7	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	17,733	20,332	1,503	1,724
8	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	195,580	132,926	16,560	11,272
9	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	—	—	0	—
	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・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または信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	—	4,013	0	340
10	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1,250%)	9,877	10,780	790	862
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	29,405	2,316	2,352
13	うち、内部格付手法準拠方式また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	29,405	2,316	2,352
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	0	—
	うち、1,250%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	104,562	9,358	8,365
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	104,562	9,358	8,365
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 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	1,165	780	98	66
24	フロア調整	—	—	0	—
25	合計	2,782,444	2,677,941	234,470	225,889
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,930,876	2,823,614		

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
		2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期
1	信用リスク	2,308,149	2,320,089	195,452	196,479
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	2,265,008	190,814	192,072
	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	55,081	4,638	4,406
4	カウンターパーティ信用リスク	85,709	37,718	6,980	3,099
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
6	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	15,156	7,384	1,285	626
	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	20,576	4,780	1,646
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	147	10	11	—
	その他	10,653	9,746	903	826
7	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	9,305	10,932	789	927
8	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	196,733	133,498	16,661	11,320
9	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・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または信用リスク・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または信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	—	4,013	—	340
10	リスク・ウェイトのみなし計算または信用リスク・アセットのみなし計算(ウォールバック方式1,250%)	9,877	10,780	790	862
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	29,405	2,316	2,352
13	うち、内部格付手法準拠方式また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	29,405	2,316	2,352
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	111,893	99,319	8,951	7,945
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	99,319	8,951	7,945
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	2,645,757	231,942	223,327
	参考:合計(スケーリングファクター勘案後)	2,899,277	2,791,592		

CR1：資産の信用の質

連結

(2022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	99,871	4,134,237	30,358	4,203,750
2	有価証券(うち負債性のもの)	59	993,875	—	993,935
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	533	927,296	812	927,016
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	100,464	6,055,409	31,171	6,124,701
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	368	34,299	72	34,595
6	コミットメント等	310	217,134	—	217,444
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	678	251,434	72	252,040
	合計				
8	合計(4+7)	101,142	6,306,843	31,244	6,376,741

(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、ならびに「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。

(2021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	95,001	3,927,250	30,531	3,991,720
2	有価証券(うち負債性のもの)	310	943,399	—	943,709
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	647	1,726,247	1,098	1,725,795
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	95,959	6,596,896	31,630	6,661,225
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	400	30,746	108	31,038
6	コミットメント等	714	209,519	—	210,233
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	1,114	240,266	108	241,272
	合計				
8	合計(4+7)	97,073	6,837,162	31,739	6,902,497

(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、ならびに「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。

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

(2022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	104,790
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	
3	デフォルトした額	10,484
4	非デフォルト状態へ復帰した額	8,549
5	償却された額	1,274
6	その他の変動額	△ 4,986
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)	100,464

(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。

(2021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	88,851
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	
3	デフォルトした額	20,365
4	非デフォルト状態へ復帰した額	5,754
5	償却された額	1,597
6	その他の変動額	△ 5,905
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)	95,959

(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

(2022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	3,610,923	592,826	233,493	138,581	—
2	有価証券(負債性のもの)	992,168	1,766	1,155	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	926,958	58	56	—	—
4	合計(1+2+3)	5,530,050	594,651	234,704	138,581	—
5	うち、デフォルトしたもの	45,223	31,085	7,987	16,310	—

(2021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	3,391,767	599,952	233,373	146,337	—
2	有価証券(負債性のもの)	941,479	2,230	1,681	—	—
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	1,725,708	86	57	—	—
4	合計(1+2+3)	6,058,955	602,269	235,113	146,337	—
5	うち、デフォルトしたもの	46,611	25,742	6,991	13,600	—

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

(2022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	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	80	—	80	—	16	20.00%				
12	法人等向け	1,665	—	1,665	—	1,665	100.00%				
13	中小企業等向けおよび個人向け	4,461	—	4,461	—	3,346	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。)	505	—	505	—	515	101.86%				
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	6,714	—	6,714	—	5,543	82.55%				

(2021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	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	87	—	87	—	17	20.00%				
12	法人等向け	1,432	—	1,432	—	1,432	100.00%				
13	中小企業等向けおよび個人向け	3,968	—	3,968	—	2,976	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。)	628	—	628	—	831	132.18%				
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	6,118	—	6,118	—	5,257	85.92%				

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

連結

(2022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	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	—	—	80	—	—	—	—	—	—	—	80
12	法人等向け	—	—	—	—	—	—	1,665	—	—	—	1,665
13	中小企業等向けおよび個人向け	—	—	—	—	—	4,461	—	—	—	—	4,461
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。)	—	—	—	—	—	—	486	18	—	—	505
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	—	80	—	—	4,461	2,152	18	—	—	6,714

(2021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	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	—	—	87	—	—	—	—	—	—	—	87
12	法人等向け	—	—	—	—	—	—	1,432	—	—	—	1,432
13	中小企業等向けおよび個人向け	—	—	—	—	—	3,968	—	—	—	—	3,968
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。)	—	—	—	—	—	—	224	404	—	—	628
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	—	87	—	—	3,968	1,656	404	—	—	6,118

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

連結

(2022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	2,201,561	89,978	0.01%	2,340,417	—	3.0	45.00%	4.5	67,407	2.88%	51	
2	0.15%以上0.25%未満	107	—	—	107	0.20%	0.0	45.00%	1.0	32	30.02%	0	
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	1,894	15	—	1,894	2.27%	0.0	45.00%	1.1	1,947	102.76%	19	
6	2.50%以上10.00%未満	1,575	—	—	1,575	6.26%	0.0	45.00%	1.0	2,273	144.30%	44	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	2,205,139	89,994	0.01%	2,343,995	0.01%	3.0	45.00%	4.5	71,661	3.05%	115	43
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	161,419	300	75.00%	161,644	0.03%	0.0	45.31%	3.5	39,330	24.33%	28	
2	0.15%以上0.25%未満	1,648	—	—	1,648	0.20%	0.0	45.00%	2.2	684	41.50%	1	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	580	—	—	580	0.62%	0.0	45.00%	2.0	409	70.52%	1	
5	0.75%以上2.50%未満	—	700	—	—	—	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	163,647	1,000	22.50%	163,872	0.04%	0.0	45.30%	3.4	40,423	24.66%	31	39
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	984,086	494,531	11.15%	1,031,354	0.06%	0.8	47.16%	2.9	275,326	26.69%	298	
2	0.15%以上0.25%未満	187,637	83,738	14.74%	193,595	0.20%	0.4	44.23%	2.9	92,844	47.95%	171	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	106,384	41,204	21.91%	111,649	0.62%	0.2	43.82%	2.8	87,115	78.02%	303	
5	0.75%以上2.50%未満	159,296	45,919	19.18%	163,285	1.49%	0.4	43.70%	3.1	180,029	110.25%	1,063	
6	2.50%以上10.00%未満	72,984	10,603	22.98%	72,284	4.64%	0.2	44.57%	3.3	112,102	155.08%	1,491	
7	10.00%以上100.00%未満	10,484	300	—	9,813	12.11%	0.0	44.02%	2.7	20,106	204.89%	523	
8	100.00%(デフォルト)	27,419	5,011	1.82%	28,613	100.00%	0.0	43.73%	1.0	—	—	12,514	
9	小計	1,548,293	681,308	12.89%	1,610,597	2.31%	2.2	46.03%	2.9	767,525	47.65%	16,366	10,086
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	75,383	43,271	8.25%	67,411	0.10%	0.5	42.96%	3.3	20,582	30.53%	30	
2	0.15%以上0.25%未満	176,305	33,727	5.23%	154,599	0.20%	1.2	41.71%	4.1	69,964	45.25%	128	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	137,302	15,297	2.22%	119,725	0.62%	1.0	41.70%	4.3	88,846	74.20%	309	
5	0.75%以上2.50%未満	226,781	14,914	14.09%	200,827	1.35%	1.5	42.05%	4.1	183,785	91.51%	1,145	
6	2.50%以上10.00%未満	155,928	10,648	10.44%	118,844	4.89%	1.1	41.70%	3.8	144,172	121.31%	2,425	
7	10.00%以上100.00%未満	34,210	418	37.68%	22,431	12.11%	0.2	42.40%	3.8	36,967	164.80%	1,151	
8	100.00%(デフォルト)	63,914	2,627	10.48%	51,941	100.00%	0.3	44.14%	1.0	—	—	22,929	
9	小計	869,826	120,905	7.71%	735,782	8.74%	6.0	42.11%	3.8	544,318	73.97%	28,121	26,250
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	277,439	—	—	277,439	0.03%	0.1	90.00%	5.0	350,604	126.37%	—	
2	0.15%以上0.25%未満	2,387	—	—	2,387	0.20%	0.0	90.00%	5.0	3,551	148.71%	—	
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50%以上0.75%未満	1,134	—	—	1,134	0.62%	0.0	90.00%	4.6	3,094	272.87%	—	
5	0.75%以上2.50%未満	3,114	—	—	3,114	2.06%	0.0	90.00%	4.7	14,518	466.12%	—	
6	2.50%以上10.00%未満	707	—	—	707	5.06%	0.0	90.00%	5.0	3,567	504.14%	—	
7	10.00%以上100.00%未満	0	—	—	0	12.11%	0.0	90.00%	5.0	0	500.00%	—	
8	100.00%(デフォルト)	98	—	—	98	100.00%	0.0	90.00%	1.0	1,108	1,124.99%	—	
9	小計	284,882	—	—	284,882	0.11%	0.2	90.00%	4.9	376,445	132.14%	—	—

(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
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	26,742	—	—	26,742	0.04%	0.0	45.00%	2.7	5,571	20.83%	5	
2	0.15%以上0.25%未満	4,390	—	—	4,390	0.20%	0.0	45.00%	2.0	1,947	44.34%	3	
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	4,858	—	—	4,858	2.13%	0.0	45.00%	3.4	6,768	139.30%	46	
6	2.50%以上10.00%未満	1,469	—	—	1,469	5.76%	0.0	45.00%	3.4	2,433	165.61%	38	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	334	—	—	334	100.00%	0.0	45.00%	1.0	—	—	150	
9	小計	37,796	—	—	37,796	1.44%	0.0	45.67%	2.7	16,720	44.23%	245	70
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	38,403	—	—	38,403	0.03%	0.0	100.00%	1.0	7,421	19.32%	14	
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	38,403	—	—	38,403	0.03%	0.0	100.00%	1.0	7,421	19.32%	14	—
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	564	—	—	564	0.03%	0.0	45.00%	3.2	136	24.23%	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	564	—	—	564	0.03%	0.0	45.00%	3.2	136	24.23%	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	62,865	43.48%	27,337	0.11%	186.7	100.00%	—	1,781	6.51%	30	
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	3,583	29,216	45.03%	16,736	1.28%	106.6	100.00%	—	7,745	46.28%	215	
6	2.50%以上10.00%未満	11,799	6,565	39.60%	14,354	3.85%	23.0	100.00%	—	14,657	102.11%	552	
7	10.00%以上100.00%未満	141	112	41.34%	187	38.63%	0.4	100.00%	—	572	305.26%	72	
8	100.00%(デフォルト)	390	111	—	390	100.00%	2.6	100.00%	—	—	—	390	
9	小計	15,913	98,871	43.63%	59,006	2.13%	319.4	100.00%	—	24,757	41.95%	1,260	384
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	412,129	—	—	411,766	0.19%	17.3	39.53%	—	62,879	15.27%	309	
3	0.25%以上0.50%未満	547,197	—	—	545,628	0.32%	42.5	39.79%	—	124,884	22.88%	712	
4	0.50%以上0.75%未満	8,340	—	—	8,278	0.60%	1.3	43.98%	—	3,252	39.28%	22	
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	6,856	—	—	6,853	15.31%	0.5	41.22%	—	14,881	217.13%	433	
8	100.00%(デフォルト)	2,735	—	—	2,869	100.00%	0.2	42.20%	—	—	—	1,211	
9	小計	977,258	—	—	975,396	0.67%	62.0	39.73%	—	205,897	21.10%	2,688	1,653

(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	72,993	6,579	97.30%	77,774	0.06%	8.3	90.64%	—	11,245	14.45%	40	
2	0.15%以上0.25%未満	58,399	338	36.64%	58,038	0.22%	3.5	54.98%	—	13,788	23.75%	70	
3	0.25%以上0.50%未満	12,811	967	92.64%	13,413	0.40%	1.9	83.52%	—	7,187	53.58%	46	
4	0.50%以上0.75%未満	18,226	0	100.00%	18,054	0.50%	4.8	64.56%	—	8,382	46.42%	58	
5	0.75%以上2.50%未満	53,689	935	52.68%	53,893	0.14%	19.0	80.03%	—	49,058	91.02%	609	
6	2.50%以上10.00%未満	4,996	283	99.80%	5,169	3.42%	0.8	65.53%	—	4,811	93.08%	117	
7	10.00%以上100.00%未満	918	—	—	904	16.36%	0.1	67.07%	—	1,237	136.78%	101	
8	100.00%(デフォルト)	5,433	13	—	6,361	100.00%	0.8	85.63%	—	—	—	5,447	
9	小計	227,469	9,118	89.91%	233,610	3.33%	39.6	76.13%	—	95,711	40.97%	6,491	1,388
	合計(全てのポートフォリオ)	6,330,834	1,001,198	14.86%	6,445,546	1.82%	432.9	48.07%	3.9	2,151,018	33.37%	55,333	39,917

(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区分に基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(全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)。

(2021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	ラ 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	3,005,610	82,060	—	3,152,331	—	3.1	45.00%	4.7	79,848	2.53%	64	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	351	—	—	351	0.36%	0.0	45.00%	1.3	166	47.33%	0	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	1,039	23	—	1,039	2.26%	0.0	45.00%	1.2	1,085	104.33%	10	
6	2.50%以上10.00%未満	316	—	—	316	6.33%	0.0	45.00%	1.0	458	144.96%	9	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00% (デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
9	小計	3,007,317	82,083	—	3,154,039	—	3.0	45.00%	4.7	81,557	2.58%	85	53
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	60,157	300	75.00%	60,382	0.04%	0.0	45.00%	3.3	17,509	28.99%	11	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	920	—	—	920	0.34%	0.0	45.00%	2.3	524	56.99%	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	61,077	800	28.12%	61,302	0.04%	0.0	45.00%	3.2	18,033	29.41%	13	16
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00%以上0.15%未満	870,371	460,880	10.50%	915,040	0.06%	0.7	47.31%	2.9	263,776	28.82%	290	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	273,472	142,093	7.98%	273,890	0.33%	0.6	44.15%	2.8	165,710	60.50%	406	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	196,574	60,024	15.43%	198,427	1.42%	0.5	44.02%	3.1	214,883	108.29%	1,246	
6	2.50%以上10.00%未満	46,673	9,178	3.76%	44,709	4.88%	0.2	43.21%	2.8	65,770	147.10%	943	
7	10.00%以上100.00%未満	13,015	1,255	0.02%	11,860	11.95%	0.0	43.50%	2.4	23,499	198.12%	616	
8	100.00% (デフォルト)	23,033	3,133	8.29%	24,227	100.00%	0.0	44.30%	1.0	—	—	10,734	
9	小計	1,423,140	676,566	10.28%	1,468,156	2.19%	2.2	46.07%	2.9	733,640	49.97%	14,238	12,390
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	57,212	39,564	9.47%	51,582	0.10%	0.4	42.96%	3.3	15,660	30.36%	23	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	305,528	52,816	5.32%	265,849	0.33%	2.1	41.82%	4.1	154,280	58.03%	376	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	273,432	22,622	10.03%	236,436	1.36%	1.9	41.88%	4.2	218,075	92.23%	1,358	
6	2.50%以上10.00%未満	145,758	9,428	12.50%	109,638	5.09%	1.1	42.17%	3.8	137,547	125.45%	2,366	
7	10.00%以上100.00%未満	41,208	222	38.59%	27,401	11.95%	0.3	41.89%	3.3	44,735	163.25%	1,371	
8	100.00% (デフォルト)	69,986	3,438	4.04%	56,305	100.00%	0.3	43.92%	1.0	—	—	24,729	
9	小計	893,126	128,092	7.98%	747,213	9.28%	6.2	42.13%	3.8	570,299	76.32%	30,226	23,510
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	353,309	—	—	353,309	0.04%	0.1	90.00%	5.0	409,829	115.99%	—	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	4,337	—	—	4,337	0.32%	0.0	90.00%	5.0	7,951	183.29%	—	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	2,476	—	—	2,476	1.67%	0.0	90.00%	4.9	7,953	321.18%	—	
6	2.50%以上10.00%未満	717	—	—	717	5.36%	0.0	90.00%	5.0	3,180	443.41%	—	
7	10.00%以上100.00%未満	0	—	—	0	11.95%	0.0	90.00%	5.0	0	500.00%	—	
8	100.00% (デフォルト)	20	—	—	20	100.00%	0.0	90.00%	1.0	225	1,124.99%	—	
9	小計	360,861	—	—	360,861	0.07%	0.2	90.00%	4.9	429,140	118.92%	—	—

(単位 百万円、千件、年)

項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ
		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
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	22,755	—	—	22,755	0.05%	0.0	45.00%	3.2	6,301	27.69%	6	
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
3	0.25%以上0.50%未満	4,871	—	—	4,871	0.32%	0.0	45.00%	4.3	3,635	74.62%	7	
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75%以上2.50%未満	1,447	—	—	1,447	2.26%	0.0	45.00%	4.0	2,158	149.08%	14	
6	2.50%以上10.00%未満	316	—	—	316	4.14%	0.0	45.00%	1.4	492	155.66%	5	
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
8	100.00%(デフォルト)	345	—	—	345	100.00%	0.0	45.00%	1.0	—	—	155	
9	小計	29,735	—	—	29,735	1.38%	0.0	45.00%	3.4	12,588	42.33%	189	79
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	30,210	—	—	30,210	0.03%	0.0	100.00%	1.0	5,792	19.17%	10	
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	30,210	—	—	30,210	0.03%	0.0	100.00%	1.0	5,792	19.17%	10	—
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	560	—	—	560	0.03%	0.0	45.00%	4.2	170	30.46%	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	560	—	—	560	0.03%	0.0	45.00%	4.2	170	30.46%	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	70,041	43.17%	30,239	0.11%	207.0	100.00%	—	1,970	6.51%	33	
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	3,691	28,443	44.95%	16,465	1.30%	105.2	100.00%	—	7,707	46.81%	214	
6	2.50%以上10.00%未満	12,055	6,528	39.88%	14,612	3.94%	23.5	100.00%	—	15,157	103.73%	575	
7	10.00%以上100.00%未満	146	107	41.76%	191	39.44%	0.4	100.00%	—	582	304.49%	75	
8	100.00%(デフォルト)	447	115	—	446	100.00%	2.7	100.00%	—	—	—	446	
9	小計	16,340	105,236	43.40%	61,955	2.17%	339.0	100.00%	—	25,418	41.02%	1,346	405
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	425,383	—	—	424,987	0.20%	18.2	39.98%	—	68,193	16.04%	339	
3	0.25%以上0.50%未満	516,955	—	—	515,407	0.34%	41.0	40.25%	—	124,549	24.16%	721	
4	0.50%以上0.75%未満	8,911	—	—	8,839	0.63%	1.3	44.63%	—	3,614	40.88%	24	
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	7,333	—	—	7,330	15.94%	0.5	41.94%	—	16,380	223.46%	491	
8	100.00%(デフォルト)	2,984	—	—	3,149	100.00%	0.3	42.64%	—	—	—	1,343	
9	小計	961,568	—	—	959,715	0.73%	61.6	40.19%	—	212,737	22.16%	2,921	2,619

(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	74,065	6,380	94.01%	78,588	0.06%	8.3	91.65%	—	12,672	16.12%	46	
2	0.15%以上0.25%未満	9,581	312	31.81%	9,547	0.18%	1.7	98.25%	—	3,535	37.02%	16	
3	0.25%以上0.50%未満	61,508	1,152	81.98%	61,769	0.28%	4.0	56.84%	—	18,693	30.26%	108	
4	0.50%以上0.75%未満	19,266	0	100.00%	19,078	0.51%	5.0	63.91%	—	8,867	46.48%	62	
5	0.75%以上2.50%未満	43,141	1,167	53.49%	43,463	1.44%	18.1	84.54%	—	41,674	95.88%	518	
6	2.50%以上10.00%未満	5,762	397	93.04%	6,005	3.47%	0.8	68.13%	—	5,822	96.95%	143	
7	10.00%以上100.00%未満	595	3	99.69%	598	17.04%	0.1	66.70%	—	830	138.73%	69	
8	100.00% (デフォルト)	5,178	50	—	6,184	100.00%	0.8	85.71%	—	—	—	5,300	
9	小計	219,099	9,464	84.95%	225,235	3.31%	39.2	77.81%	—	92,095	40.88%	6,267	2,444
	合計(全てのポートフォリオ)	6,972,741	1,002,243	13.34%	7,068,689	1.66%	451.9	48.31%	4.1	2,181,475	30.86%	55,297	41,519

- (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区分に基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(全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

(2022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。

(2021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

(2022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け(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	—	407	50%	305	—	—	—	305	152	—
	2.5年以上	9,302	—	70%	4,860	—	—	4,442	9,302	6,511	37
良(Good)	2.5年未満	263	508	70%	644	—	—	—	644	451	2
	2.5年以上	9,583	7,832	90%	8,503	2,812	—	4,141	15,457	13,912	123
可(Satisfactory)		31,259	8,487	115%	34,339	3,285	—	—	37,624	43,268	1,053
弱い(Weak)		8,817	426	250%	1,913	5,224	—	2,000	9,137	22,844	731
デフォルト(Default)		4,394	—	—	4,394	—	—	—	4,394	—	2,197
合計		63,620	17,661	—	54,960	11,322	—	10,583	76,866	87,140	4,145
ポラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(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	500	—	95%	500					475	2
良(Good)	2.5年未満	—	—	95%	—					—	—
	2.5年以上	—	—	120%	—					—	—
可(Satisfactory)		—	—	140%	—					—	—
弱い(Weak)		—	—	250%	—					—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—					—	—
合計		500	—	—	500					475	2
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	4,408	—	300%	4,408					13,226	—	
簡易手法 - 非上場株式	1,121	—	400%	1,121					4,486	—	
内部モデル手法	—	—	—	—					—	—	
合計	5,530	—	—	5,530					17,712	—	
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	21	—	100%	21					21	—	

(2021年度中間期末)

(単位 百万円)

規制上の区分	残存期間	特定貸付債権(スロッシング・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け(HVCRE)以外					信用リスク・アセットの額	期待損失
		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	PF	OF	CF	IPRE	合計		
優(Strong)	2.5年未満	—	1,303	50%	977	—	—	—	977	488	—
	2.5年以上	836	860	70%	1,481	—	—	—	1,481	1,036	5
良(Good)	2.5年未満	272	757	70%	840	—	—	—	840	588	3
	2.5年以上	3,026	3,141	90%	5,293	—	—	89	5,382	4,844	43
可(Satisfactory)		29,142	12,101	115%	37,218	—	—	1,000	38,218	43,951	1,070
弱い(Weak)		6,900	—	250%	5,176	1,724	—	—	6,900	17,251	552
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		40,178	18,164	—	50,988	1,724	—	1,089	53,802	68,162	1,674

ポラティリティの高い事業用不動産向け貸付け(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	1,970	—	120%	1,970	2,364	7
可(Satisfactory)		500	—	140%	500	700	14
弱い(Weak)		—	—	250%	—	—	—
デフォルト(Default)		—	—	—	—	—	—
合計		2,470	—	—	2,470	3,064	21

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
簡易手法 - 上場株式	5,272	—	300%	5,272	15,818
簡易手法 - 非上場株式	1,117	7	400%	1,122	4,490
内部モデル手法	—	—	—	—	—
合計	6,389	7	—	6,395	20,308

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
--	----	---	------	----	----

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

(2022年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	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
1	SA-CCR	—	—	—	1.4	—	—
2	カレント・エクスポージャー方式	31,570	10,265	—	—	41,835	15,156
3	期待エクスポージャー方式	—	—	—	—	—	—
4	信用リスク削減手法における簡便手法	—	—	—	—	777,843	10,653
5	信用リスク削減手法における包括的手法	—	—	—	—	—	—
6	合計	—	—	—	—	—	25,809

(2021年度中間期末)

(単位 百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	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
1	SA-CCR	—	—	—	1.4	—	—
2	カレント・エクスポージャー方式	6,683	10,832	—	—	17,516	7,384
3	期待エクスポージャー方式	—	—	—	—	—	—
4	信用リスク削減手法における簡便手法	—	—	—	—	—	—
5	信用リスク削減手法における包括的手法	—	—	—	—	1,580,687	9,746
6	合計	—	—	—	—	—	17,131

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

連結

(2022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	30,195	59,752
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	30,195	59,752

(2021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	13,673	20,576
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	13,673	20,576

CCR3：業種別およびリスク・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

(2022年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	リスク・ウェイト 業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	
		与信相当額(信用リスク削減手法勘案後)									
		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計	
1	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	中小企業等向けおよび個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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。

(2021年度中間期末)

(単位 百万円)

項番	リスク・ウェイト 業種	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	
		与信相当額(信用リスク削減手法勘案後)									
		0%	10%	20%	50%	75%	100%	150%	その他	合計	
1	日本国政府および日本銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2	外国の中央政府および中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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	金融機関および第一種金融商品取引業者向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	法人等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
12	中小企業等向けおよび個人向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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 - ポートフォリオ別および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

(2022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 削減手法勘案後)	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	584,111	0.00%	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	584,111	0.00%	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	232,168	0.03%	0.0	22.22%	1.0	23,517	10.12%
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	232,168	0.03%	0.0	22.22%	1.0	23,517	10.12%
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	1,839	0.10%	0.0	44.43%	3.8	715	38.91%
2	0.15%以上0.25%未満	238	0.20%	0.0	42.80%	2.9	93	39.36%
3	0.25%以上0.50%未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50%以上0.75%未満	90	0.62%	0.0	44.90%	1.8	56	62.24%
5	0.75%以上2.50%未満	923	1.55%	0.0	44.88%	4.6	1,229	133.16%
6	2.50%以上10.00%未満	125	4.06%	0.0	44.94%	3.1	174	138.79%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	155	100.00%	0.0	45.00%	2.2	—	—
9	小計	3,374	5.28%	0.0	44.50%	3.8	2,270	67.30%
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	0	0.11%	0.0	86.70%	—	0	23.05%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	7	0.38%	0.0	86.70%	—	3	53.09%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	17	1.28%	0.0	86.32%	—	17	96.88%
6	2.50%以上10.00%未満	0	3.32%	0.0	46.54%	—	0	65.84%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	25	1.00%	0.0	86.32%	—	21	82.95%
合計(全てのポートフォリオ)		819,679	0.03%	0.1	38.54%	3.8	25,809	3.14%

(2021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	1,222,511	0.00%	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	1,222,511	0.00%	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	135,831	0.04%	0.0	21.65%	0.9	13,539	9.96%
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	135,831	0.04%	0.0	21.65%	0.9	13,539	9.96%
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	237,531	0.09%	0.0	1.26%	0.0	1,277	0.53%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	1,016	0.33%	0.0	44.03%	3.0	595	58.58%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	1,215	2.04%	0.0	44.56%	4.3	1,632	134.29%
6	2.50%以上10.00%未満	67	4.15%	0.0	44.27%	2.0	85	127.07%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	29	100.00%	0.0	45.00%	1.7	—	—
9	小計	239,859	0.11%	0.1	1.67%	0.0	3,590	1.49%
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	0	0.11%	0.0	87.43%	—	0	23.24%
2	0.15%以上0.25%未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25%以上0.50%未満	0	0.36%	0.0	87.43%	—	0	51.81%
4	0.50%以上0.75%未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75%以上2.50%未満	0	1.29%	0.0	47.67%	—	0	53.65%
6	2.50%以上10.00%未満	0	3.39%	0.0	47.67%	—	0	67.61%
7	10.00%以上100.00%未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100%(デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	1	0.44%	0.0	83.97%	—	0	38.41%
合計(全てのポートフォリオ)		1,598,204	0.02%	0.1	36.51%	3.9	17,131	1.07%

CCR5：担保の内訳

連結

(2022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)	—	—	—	—	—	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	120,714	—
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	—	—	—	—	120,714	—

(2021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)	—	—	—	—	237,546	—
2	現金(外国通貨)	—	—	—	—	72,441	—
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	—	—	—	—	309,988	—

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

(2022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。

(2021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

(2022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)		147
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。)	3,688	147
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	3,306	132
4	(ii) 派生商品取引(上場)	381	15
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合のネットリング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	7,423	—
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・ネットリングが承認された場合のネットリング・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	—	—

(2021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)		10
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。)	269	10
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	—	—
4	(ii) 派生商品取引(上場)	269	10
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合のネットリング・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・ネットリングが承認された場合のネットリング・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

(2022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)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	142,885	—	142,885	—	—	—	—	—	—	—			
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	142,885	—	142,885	—	—	—	—	—	—	—			
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)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	900	1,217	2,118	—	—	—	—	—	—	—			
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1,217	1,217	—	—	—	—	—	—	—			
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	900	—	900	—	—	—	—	—	—	—			
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—			

(2021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)	—	—	—	—	—	—	142,949	—	142,949
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	142,949	—	142,949
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)	—	—	—	—	—	—	1,663	2,824	4,487
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	2,824	2,824
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	—	—	—	—	—	—	1,663	—	1,663
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および関連する所要自己資本
(自金融機関がオリジネーターまたはスポンサーである場合)

連結

(2022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また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また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また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また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。

(2021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また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また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また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また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およ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

(2022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	145,003	143,785	143,785	142,885	900	—	—	—	1,217	1,217	—	1,217	—	—	—
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また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	145,003	143,785	143,785	142,885	900	—	—	—	1,217	1,217	—	1,217	—	—	
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また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	28,950	28,757	28,757	28,577	180	—	—	—	192	192	—	192	—	—	
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また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	2,316	2,300	2,300	2,286	14	—	—	—	15	15	—	15	—	—	
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(2021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
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	147,436	144,612	144,612	142,949	1,663	—	—	—	2,824	2,824	—	2,824	—	—	—
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また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	147,436	144,612	144,612	142,949	1,663	—	—	—	2,824	2,824	—	2,824	—	—	
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また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	29,405	28,922	28,922	28,589	332	—	—	—	482	482	—	482	—	—	
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また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	2,352	2,313	2,313	2,287	26	—	—	—	38	38	—	38	—	—	
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	
		ΔEVE		ΔNII		ΔEVE		ΔNII	
		2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期
1	上方パラレルシフト	43,125	41,060	25	612				
2	下方パラレルシフト	442	0	8,153	862				
3	スティープ化	24,480	24,442						
4	フラット化	538	14						
5	短期金利上昇	5,588	4,554						
6	短期金利低下	0	0						
7	最大値	43,125	41,060	8,153	862				
		ホ				ハ			
		2022年度中間期				2021年度中間期			
8	Tier1 資本の額	392,761				476,913			

単体

(単位 百万円)

項番		イ		ロ		ハ		ニ	
		ΔEVE		ΔNII		ΔEVE		ΔNII	
		2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期	2022年度中間期	2021年度中間期
1	上方パラレルシフト	43,125	41,060	25	612				
2	下方パラレルシフト	442	0	8,153	862				
3	スティープ化	24,480	24,442						
4	フラット化	538	14						
5	短期金利上昇	5,588	4,554						
6	短期金利低下	0	0						
7	最大値	43,125	41,060	8,153	862				
		ホ				ハ			
		2022年度中間期				2021年度中間期			
8	Tier1 資本の額	379,764				464,002			

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国または地域別の状況

連結

(2022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または地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国または地域	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また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%	1,354		
小計		1,354		
合計		2,486,187	0.00%	—

(注)原則最終リスク国ベースで算出しております。

(2021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または地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国または地域	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また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%	888		
ルクセンブルク	0.50%	10		
小計		898		
合計		2,524,442	0.00%	—

(注)原則最終リスク国ベースで算出しております。