

Ⅷ. 定量的な開示事項【単体】

1. 自己資本比率（第3の柱）に関する告示別紙様式第2号により開示する事項

(1) OV1

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2022年3月31日	2021年3月31日	2022年3月31日	2021年3月31日
1	信用リスク	2,685,492	2,760,036	227,546	233,856
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,647,344	2,719,515	224,494	230,614
	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	38,147	40,521	3,051	3,241
4	カウンターパーティ信用リスク	73,550	79,664	6,048	6,514
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	16,463	17,894	1,396	1,517
	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	36,290	45,514	2,903	3,641
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,901	4,668	232	373
	その他	17,894	11,586	1,517	982
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	448,814	496,213	38,059	42,078
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)	307,713	327,177	26,094	27,744
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%)	—	—	—	—
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	116,460	99,643	9,316	7,971
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	116,460	99,643	9,316	7,971
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	146,720	144,422	11,737	11,553
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,720	144,422	11,737	11,553
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	9,363	10,253	794	869
	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	3,788,114	3,917,411	319,597	330,589

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年3月31日	2021年3月31日	2022年3月31日	2021年3月31日
1	上方平行シフト	38,283	32,556	△2,163	△3,440
2	下方平行シフト	13,227	19,614	9,940	7,430
3	スティープ化	22,285	19,252		
4	フラット化	9,289	13,631		
5	短期金利上昇	13,594	15,583		
6	短期金利低下	0	781		
7	最大値	38,283	32,556	9,940	7,430
		ホ		へ	
		2022年3月31日		2021年3月31日	
8	Tier1資本の額	518,767		527,789	