

## 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	
		2020年9月30日	2019年9月30日	2020年9月30日	2019年9月30日
1	信用リスク	2,797,347	2,659,369	237,014	225,302
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,755,492	2,615,215	233,665	221,770
	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	41,854	44,154	3,348	3,532
4	カウンターパーティ信用リスク	86,881	71,228	7,140	5,878
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	24,001	22,230	2,035	1,885
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	41,441	28,771	3,315	2,301
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,768	5,014	461	401
	その他	15,669	15,212	1,328	1,290
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	405,434	464,206	34,380	39,364
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)	261,048	284,001	22,136	24,083
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 (マデート方式)	—	—	—	—
	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	105,773	101,743	8,461	8,139
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	105,773	101,743	8,461	8,139
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	145,503	148,419	11,640	11,873
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	145,503	148,419	11,640	11,873
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	9,748	10,508	826	891
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計	3,811,736	3,739,478	321,601	315,532

## (2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2020年9月30日	2019年9月30日	2020年9月30日	2019年9月30日
1	上方平行シフト	13,451	30,564	△6,505	△5,401
2	下方平行シフト	18,477	—	10,260	5,575
3	スティープ化	8,150	16,097		
4	フラット化	15,432	5,357		
5	短期金利上昇	10,571	12,700		
6	短期金利低下	846	4,888		
7	最大値	18,477	30,564	10,260	5,575
		ホ		ハ	
		2020年9月30日		2019年9月30日	
8	Tier1資本の額	508,033		522,650	