

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) OVI

(単位：百万円)

OVI：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	
		2021年9月30日	2020年9月30日	2021年9月30日	2020年9月30日
1	信用リスク	2,725,702	2,797,347	230,949	237,014
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,686,171	2,755,492	227,787	233,665
	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	39,530	41,854	3,162	3,348
4	カウンターパーティ信用リスク	67,862	86,881	5,564	7,140
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	15,790	24,001	1,339	2,035
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	34,905	41,441	2,792	3,315
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,711	5,768	376	461
	その他	12,455	15,669	1,056	1,328
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	539,960	405,434	45,788	34,380
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)	334,298	261,048	28,348	22,136
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 (マンドレート方式)	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	—	—	—	—
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式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	110,429	105,773	8,834	8,461
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	110,429	105,773	8,834	8,461
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	144,971	145,503	11,597	11,640
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	144,971	145,503	11,597	11,640
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	10,272	9,748	871	826
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計	3,933,497	3,811,736	331,954	321,601

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2021年9月30日	2020年9月30日	2021年9月30日	2020年9月30日
1	上方平行シフト	40,876	13,451	746	△6,505
2	下方平行シフト	34,357	18,477	6,544	10,260
3	スティープ化	29,967	8,150		
4	フラット化	20,456	15,432		
5	短期金利上昇	17,168	10,571		
6	短期金利低下	4,327	846		
7	最大値	40,876	18,477	6,544	10,260
		ホ		へ	
		2021年9月30日		2020年9月30日	
8	Tier1資本の額	544,287		508,033	