

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		リスク・アセット		所要自己資本	
		イ	ロ	ハ	ニ
		2021年3月31日	2020年3月31日	2021年3月31日	2020年3月31日
1	信用リスク	2,775,585	2,672,121	235,175	226,391
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,735,063	2,629,556	231,933	222,986
	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	40,521	42,565	3,241	3,405
4	カウンターパーティ信用リスク	79,664	59,746	6,514	4,909
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	17,894	22,308	1,517	1,891
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	45,514	27,398	3,641	2,191
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,668	5,411	373	432
	その他	11,586	4,628	982	392
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	496,213	373,525	42,078	31,674
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)	327,177	248,520	27,744	21,074
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 (マニフェスト方式)	—	—	—	—
	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	99,643	105,341	7,971	8,427
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	99,643	105,341	7,971	8,427
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	144,422	146,058	11,553	11,684
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	144,422	146,058	11,553	11,684
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	10,253	15,796	869	1,339
	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	3,932,959	3,621,111	331,908	305,501

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク		イ	ロ	ハ	ニ
項番		△EVE		△NII	
		2021年3月31日	2020年3月31日	2021年3月31日	2020年3月31日
1	上方平行シフト	32,556	18,118	△3,440	△6,606
2	下方平行シフト	19,614	9,500	7,430	7,631
3	スティープ化	19,252	11,693		
4	フラット化	13,631	12,371		
5	短期金利上昇	15,583	9,776		
6	短期金利低下	781	5,910		
7	最大値	32,556	18,118	7,430	7,631
		ホ		ハ	
		2021年3月31日		2020年3月31日	
8	Tier1資本の額	527,633		484,994	