

Ⅲ. 定量的な開示事項

1. その他金融機関等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及び所要自己資本を下回った額の総額

該当事項はありません。

2. 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が適用されるエクスポージャーに関する事項

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)

	2019年度中間期末
ルック・スルー方式（自己資本比率告示第167条第2項）	250,579
マンドート方式（自己資本比率告示第167条第7項）	6,801
蓋然性方式（250％）（自己資本比率告示第167条第10項第1号）	—
蓋然性方式（400％）（自己資本比率告示第167条第10項第2号）	—
フォールバック方式（自己資本比率告示第167条第11項）	—
合計	257,381

(単位：百万円)

	2018年度中間期末
ルックスルー方式（旧自己資本比率告示第167条第1項）	84,815
修正単純過半数方式（旧自己資本比率告示第167条第2項）	62,660
マンドート方式（旧自己資本比率告示第167条第3項）	3,908
簡便方式（旧自己資本比率告示第167条第5項）	—
合計	151,384

3. その他の定量的開示事項（別紙様式）

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	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年度 中間期末	2018年度 中間期末	2019年度 中間期末	2018年度 中間期末
1	信用リスク	3,193,040	3,209,342	270,003	271,423
2	うち、標準的手法適用分	90,853	82,930	7,268	6,634
3	うち、内部格付手法適用分	3,033,371	3,057,494	257,229	259,275
	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	68,816	68,917	5,505	5,513
4	カウンターパーティ信用リスク	29,561	31,527	2,433	2,591
5	うち、S A - C C R適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	12,779	12,492	1,083	1,059
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	15,280	17,102	1,222	1,368
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	62	1	4
	その他	1,478	1,870	125	158
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	273,703	259,642	23,210	22,017
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）	372,999		31,630	
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）	27,207		2,307	
	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%）	—		—	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		—		—
	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		260,970		22,130
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	29	20	2	1
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	29		2	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		20		1
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	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	163,938	168,889	13,115	13,511
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	163,938	168,889	13,115	13,511
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	12,377	10,591	1,049	898
	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	4,072,858	3,940,984	343,751	332,573

- (注) 1. リスク・アセットの額は、自己資本比率告示第152条に定めるスケーリング・ファクター（1.06）を乗じる前の額を記載しております。
2. 所要自己資本の額は、リスク・アセットの額（内部格付手法が適用される資産には、スケーリング・ファクター（1.06）を乗じた後の額）に8%を乗じた額を記載しております。

【単体】

(単位：百万円)

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	
		2019年度 中間期末	2018年度 中間期末	2019年度 中間期末	2018年度 中間期末
1	信用リスク	3,145,062	3,162,729	266,314	267,824
2	うち、標準的手法適用分	15,116	12,261	1,209	980
3	うち、内部格付手法適用分	3,064,531	3,084,654	259,872	261,578
	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	65,414	65,813	5,233	5,265
4	カウンターパーティ信用リスク	29,561	31,527	2,433	2,591
5	うち、S A-C C R適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	12,779	12,492	1,083	1,059
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、C V Aリスク	15,280	17,102	1,222	1,368
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	62	1	4
	その他	1,478	1,870	125	158
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	270,203	256,950	22,913	21,789
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）	373,762		31,695	
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）	27,207		2,307	
	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%）	—		—	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		—		—
	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		261,896		22,208
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	29	20	2	1
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	29		2	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		20		1
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	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	155,246	160,845	12,419	12,867
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,246	160,845	12,419	12,867
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	3,971	4,262	336	361
	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	4,005,045	3,878,233	338,422	327,645

- (注) 1. リスク・アセットの額は、自己資本比率告示第152条に定めるスケーリング・ファクター（1.06）を乗じる前の額を記載しております。
2. 所要自己資本の額は、リスク・アセットの額（内部格付手法が適用される資産には、スケーリング・ファクター（1.06）を乗じた後の額）に8%を乗じた額を記載しております。

【連結】

2019年度中間期末

(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	119,920	5,379,782	41,980	5,457,721
2	有価証券（うち負債性のもの）	70	1,359,845	—	1,359,916
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	1,528	908,999	3,027	907,500
4	オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）	121,519	7,648,627	45,008	7,725,138
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	42	10,244	32	10,253
6	コミットメント等	—	88,404	64	88,340
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）	42	98,648	97	98,593
合計					
8	合計（4+7）	121,561	7,747,275	45,105	7,823,732

- (注) 1. 項番2「有価証券（うち負債性のもの）」には、株式以外の有価証券に該当するものを計上しております。
2. 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、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、貸出金に係る仮払金、貸出金・有価証券（負債性のもの）に係る未収利息を計上しております。
3. 項番6「コミットメント等」には、コミットメントのうち、取消不能なコミットメント（条件の有無にかかわらず取消可能なコミットメントを除く。）を計上しております。

2018年度中間期末

(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	110,199	5,390,540	36,740	5,463,999
2	有価証券（うち負債性のもの）	66	1,326,750	—	1,326,817
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	1,188	764,285	2,536	762,937
4	オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）	111,454	7,481,576	39,277	7,553,753
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	48	11,114	37	11,125
6	コミットメント等	—	95,711	43	95,668
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）	48	106,825	80	106,793
合計					
8	合計（4+7）	111,503	7,588,402	39,357	7,660,547

- (注) 1. 項番2「有価証券（うち負債性のもの）」には、株式以外の有価証券に該当するものを計上しております。
2. 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、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、貸出金に係る仮払金、貸出金・有価証券（負債性のもの）に係る未収利息を計上しております。
3. 項番6「コミットメント等」には、コミットメントのうち、取消不能なコミットメント（条件の有無にかかわらず取消可能なコミットメントを除く。）を計上しております。

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】

2019年度中間期末

(単位：百万円)

項番		額
1	2018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	114,938
2		デフォルトした額
3	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	非デフォルト状態へ復帰した額
4		償却された額
5		その他の変動額
6	2019年度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）	121,519

(注) その他の変動額の主な発生要因は、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少であります。

2018年度中間期末

(単位：百万円)

項番		額
1	2017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	106,849
2		デフォルトした額
3	貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の前中間期中の要因別の変動額	非デフォルト状態へ復帰した額
4		償却された額
5		その他の変動額
6	2018年度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）	111,454

(注) その他の変動額の主な発生要因は、デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少であります。

CR3：信用リスク削減手法

【連結】

2019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	3,790,990	1,666,731	1,068,230	180,039	—
2	有価証券（負債性のもの）	1,331,339	28,576	—	28,425	—
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	906,916	584	290	142	—
4	合計（1+2+3）	6,029,246	1,695,892	1,068,520	208,607	—
5	うちデフォルトしたもの	68,055	24,533	20,531	21,950	—

(注) 1. 項番2「有価証券（負債性のもの）」には、株式以外の有価証券に該当するものを計上しております。

2. 項番3「その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）」には、預け金、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、貸出金に係る仮払金、貸出金・有価証券（負債性のもの）に係る未収利息を計上しております。

2018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	3,577,316	1,886,682	1,051,360	182,814	—
2	有価証券（負債性のもの）	1,291,101	35,715	—	35,097	—
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	762,288	649	303	156	—
4	合計（1+2+3）	5,630,705	1,923,047	1,051,663	218,068	—
5	うちデフォルトしたもの	33,895	53,285	18,027	22,885	—

(注) 1. 項番2「有価証券（負債性のもの）」には、株式以外の有価証券に該当するものを計上しております。

2. 項番3「その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）」には、預け金、買入金銭債権、金銭の信託、外国為替、貸出金に係る仮払金、貸出金・有価証券（負債性のもの）に係る未収利息を計上しております。

【連結】

2019年度中間期末

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	イ		ロ		ハ		ニ		ホ 信用リスク・ アセットの額	ヘ リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
		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		信用リスク・ アセットの額			
		オン・バラン スシートの額	オフ・バラン スシートの額	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	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	0	—	0	—	—	—	—	—	—	
2	日本国政府及び日本銀行向け	3	—	110	—	—	—	—	—	—	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	535	—	—	—	—	—	—	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	532	—	532	—	—	—	—	—	—	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	535	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	426	—	426	—	—	—	—	—	—	
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	183	—	76	—	—	—	7	—	9.99	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	26,071	—	26,071	—	—	—	5,214	—	19.99	
12	法人等向け	76,073	—	76,073	—	—	—	76,071	—	99.99	
13	中小企業等向け及び個人向け	12,286	—	12,286	—	—	—	9,214	—	74.99	
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。）	233	—	233	—	—	—	344	—	147.37	
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	116,347	—	116,347	—	—	—	90,853	—	78.08	

2018年度中間期末

(単位：百万円、%)

項番	資産クラス	イ		ロ		ハ		ニ		ホ 信用リスク・ アセットの額	ヘ リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
		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		信用リスク・ アセットの額			
		オン・バラン スシートの額	オフ・バラン スシートの額	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	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	0	—	0	—	—	—	—	—	—	
2	日本国政府及び日本銀行向け	4	—	113	—	—	—	—	—	—	
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	546	—	—	—	—	—	—	
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	我が国の地方公共団体向け	891	—	891	—	—	—	—	—	—	
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	546	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	国際開発銀行向け	769	—	769	—	—	—	—	—	—	
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	186	—	77	—	—	—	7	—	9.99	
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	7,658	—	7,658	—	—	—	1,531	—	20.00	
12	法人等向け	72,890	—	72,890	—	—	—	72,888	—	99.99	
13	中小企業等向け及び個人向け	11,150	—	11,150	—	—	—	8,362	—	74.99	
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。）	122	—	122	—	—	—	139	—	114.13	
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	94,221	—	94,221	—	—	—	82,930	—	88.01	

【連結】

2019年度中間期末

(単位：百万円)

項番	資産クラス リスク・ウェイト	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)										
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1,250%	合計
1	現金	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0
2	日本国政府及び日本銀行向け	110	—	—	—	—	—	—	—	—	—	110
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	535	—	—	—	—	—	—	—	—	—	535
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け	532	—	—	—	—	—	—	—	—	—	532
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	426	—	—	—	—	—	—	—	—	—	426
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	—	76	—	—	—	—	—	—	—	—	76
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	26,071	—	—	—	—	—	—	—	26,071
12	法人等向け	—	—	—	—	2	—	76,070	—	—	—	76,073
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	12,286	—	—	—	—	12,286
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。）	—	—	—	—	6	—	—	227	—	—	233
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	1,606	76	26,071	—	8	12,286	76,070	227	—	—	116,347

2018年度中間期末

(単位：百万円)

項番	資産クラス リスク・ウェイト	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)										
		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル
		0%	10%	20%	35%	50%	75%	100%	150%	250%	1,250%	合計
1	現金	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0
2	日本国政府及び日本銀行向け	113	—	—	—	—	—	—	—	—	—	113
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	546	—	—	—	—	—	—	—	—	—	546
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け	891	—	—	—	—	—	—	—	—	—	891
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	769	—	—	—	—	—	—	—	—	—	769
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	—	77	—	—	—	—	—	—	—	—	77
10	地方三公社向け	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	—	—	7,658	—	—	—	—	—	—	—	7,658
12	法人等向け	—	—	0	—	4	—	72,886	—	—	—	72,890
13	中小企業等向け及び個人向け	—	—	—	—	—	11,150	—	—	—	—	11,150
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。）	—	—	—	—	39	—	8	74	—	—	122
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	2,321	77	7,658	—	44	11,150	72,894	74	—	—	94,221

【連結】

2019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	2,054,237	255,171	0.00	2,198,172	0.00	0.1	45.40	4.0	39,654	1.80	28	
2	0.15以上0.25未満	4,272	—	—	13,006	0.15	0.0	43.64	4.1	2,861	21.99	9	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	20	0.26	0.0	29.00	4.9	2	14.28	0	
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75以上2.50未満	1,250	467	75.00	1,600	1.75	0.0	45.00	3.1	1,904	118.99	12	
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
7	10.00以上100.00未満	3,327	—	—	3,327	15.79	0.0	45.00	5.0	8,385	251.96	236	
8	100.00 (デフォルト)	1,650	—	—	1,650	100.00	0.0	45.00	5.0	—	—	742	
9	小計	2,064,738	255,638	0.14	2,217,778	0.10	0.1	45.39	4.0	52,808	2.38	1,029	232
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	117,887	5,000	75.00	121,637	0.05	0.0	46.45	2.8	36,803	30.25	29	
2	0.15以上0.25未満	23,492	—	—	23,492	0.16	0.0	45.00	1.7	8,226	35.01	16	
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	2	770	0.05	2	1.75	0.0	37.60	2.1	2	82.95	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	141,381	5,770	64.99	145,132	0.06	0.0	46.22	2.7	45,031	31.02	46	10
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	525,000	83,045	41.63	558,923	0.05	0.2	45.49	2.4	128,809	23.04	141	
2	0.15以上0.25未満	405,542	51,175	34.28	415,983	0.16	0.5	44.73	2.3	158,443	38.08	298	
3	0.25以上0.50未満	250,595	8,026	33.68	250,842	0.26	0.7	44.08	2.4	119,384	47.59	288	
4	0.50以上0.75未満	160,115	5,188	14.99	157,200	0.67	0.5	42.73	2.8	124,672	79.30	456	
5	0.75以上2.50未満	265,565	14,901	28.22	284,343	1.67	1.2	44.31	3.1	300,842	105.80	2,072	
6	2.50以上10.00未満	31,871	1,171	46.00	29,484	4.74	0.1	41.76	3.1	42,173	143.03	582	
7	10.00以上100.00未満	24,437	151	84.45	20,675	15.79	0.1	42.41	2.6	44,244	213.99	1,384	
8	100.00 (デフォルト)	35,533	88	0.00	32,057	100.00	0.1	43.18	3.0	—	—	13,843	
9	小計	1,698,662	163,749	36.93	1,749,510	2.52	3.9	44.52	2.6	918,572	52.50	19,068	16,924
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	500	—	—	500	0.06	0.0	45.00	3.8	132	26.48	0	
2	0.15以上0.25未満	52,148	2,641	30.52	49,910	0.16	0.2	42.46	2.5	16,562	33.18	33	
3	0.25以上0.50未満	349,622	6,740	49.31	339,860	0.26	2.4	41.33	3.6	158,341	46.59	365	
4	0.50以上0.75未満	489,498	1,746	24.26	479,251	0.67	3.3	40.30	4.4	356,514	74.38	1,313	
5	0.75以上2.50未満	645,371	4,629	51.61	625,508	1.75	4.8	40.82	4.3	609,960	97.51	4,468	
6	2.50以上10.00未満	70,526	625	43.65	57,127	5.07	0.6	40.99	3.2	68,017	119.06	1,191	
7	10.00以上100.00未満	75,924	164	29.02	62,506	15.79	0.6	41.31	4.0	113,014	180.80	4,077	
8	100.00 (デフォルト)	62,844	89	41.31	48,963	100.00	0.3	42.81	2.9	—	—	20,964	
9	小計	1,746,435	16,638	43.88	1,663,628	4.62	12.5	40.91	4.0	1,322,544	79.49	32,413	18,156

(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
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
株式等エクスポージャー (PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る)													
1	0.00以上0.15未満	115,166	—	—	115,166	0.10	0.0	90.00	5.0	116,866	101.47	105	—
2	0.15以上0.25未満	9,793	—	—	9,793	0.16	0.0	90.00	5.0	12,260	125.19	14	—
3	0.25以上0.50未満	2,566	—	—	2,566	0.26	0.0	90.00	5.0	3,967	154.60	6	—
4	0.50以上0.75未満	232	—	—	232	0.68	0.0	90.00	5.0	750	323.16	1	—
5	0.75以上2.50未満	778	—	—	778	1.75	0.0	90.00	5.0	3,122	401.09	12	—
6	2.50以上10.00未満	34	—	—	34	4.38	0.0	90.00	5.0	137	396.69	1	—
7	10.00以上100.00未満	0	—	—	0	15.79	0.0	90.00	5.0	0	681.56	0	—
8	100.00 (デフォルト)	17	—	—	17	100.00	0.0	90.00	5.0	191	1,125.00	15	—
9	小計	128,587	—	—	128,587	0.13	0.1	90.00	5.0	137,295	106.77	155	—
購入債権 (事業法人等向け)													
1	0.00以上0.15未満	453	—	—	453	0.01	0.0	45.00	5.0	67	14.84	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	453	—	—	453	0.01	0.0	45.00	5.0	67	14.84	0	0
購入債権 (リテール向け)													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(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
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	11,645	58,969	38.14	27,419	1.06	177.3	75.99	—	8,258	30.12	221	—
6	2.50以上10.00未満	16,074	264	265.64	6,708	3.67	23.6	76.00	—	4,991	74.40	187	—
7	10.00以上100.00未満	135	15	29.55	71	47.24	0.2	76.00	—	162	227.90	25	—
8	100.00 (デフォルト)	422	60	41.84	357	100.00	1.0	76.00	—	89	25.00	264	—
9	小計	28,277	59,310	39.16	34,557	2.69	202.3	75.99	—	13,502	39.07	699	464
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	412,893	—	—	412,780	0.10	20.0	40.76	—	40,245	9.74	171	—
2	0.15以上0.25未満	236,770	—	—	236,543	0.17	21.0	37.84	—	32,604	13.78	157	—
3	0.25以上0.50未満	363,609	—	—	363,429	0.42	28.3	39.94	—	100,122	27.54	614	—
4	0.50以上0.75未満	126,518	—	—	126,473	0.69	8.8	39.93	—	49,743	39.33	353	—
5	0.75以上2.50未満	157,912	—	—	141,318	0.90	15.1	38.01	—	62,650	44.33	486	—
6	2.50以上10.00未満	14,484	—	—	13,691	9.67	1.7	37.35	—	22,930	167.47	495	—
7	10.00以上100.00未満	332	—	—	312	50.27	0.0	37.61	—	589	188.76	59	—
8	100.00 (デフォルト)	3,941	—	—	3,655	100.00	0.4	39.46	—	1,468	40.17	1,325	—
9	小計	1,316,464	—	—	1,298,205	0.74	95.6	39.58	—	310,354	23.90	3,662	2,102
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	181,799	2,224	27.03	169,312	0.29	12.5	46.19	—	41,197	24.33	234	—
4	0.50以上0.75未満	165,469	41	20.67	162,003	0.71	21.7	43.99	—	62,167	38.37	512	—
5	0.75以上2.50未満	178,763	1,502	20.75	161,256	2.06	48.7	46.34	—	94,894	58.84	1,538	—
6	2.50以上10.00未満	43,809	281	45.20	20,456	5.70	11.9	46.50	—	14,188	69.36	526	—
7	10.00以上100.00未満	375	—	—	316	78.62	0.0	46.85	—	231	73.24	116	—
8	100.00 (デフォルト)	15,624	15	47.36	11,176	100.00	1.3	44.96	—	7,983	71.43	4,387	—
9	小計	585,843	4,064	25.97	524,521	3.35	96.4	45.54	—	220,663	42.06	7,315	4,250
合計 (すべてのポートフォリオ)		7,710,845	505,171	19.03	7,762,375	1.95	411.2	44.16	3.6	3,020,841	38.91	64,391	42,143

- (注) 1. 信用リスク削減手法により保証人のPDを用いてリスク・アセットを算出する明細については、イ欄からハ欄については原債務者の資産区分、ニ欄からラ欄については保証人の資産区分に集計しております。一部のみ保証でカバーされる明細については、原債務者、保証人の資産区分にそれぞれ集計しております。
2. 「適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー」「居住用不動産向けエクスポージャー」「その他リテール向けエクスポージャー」については、債権単位でPD推計を行っているため、ヘ欄には「債権の数」を記載しております。

2018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	1,933,111	253,354	0.01	2,079,073	0.00	0.0	45.42	3.8	33,084	1.59	29	
2	0.15以上0.25未満	5,448	—	—	14,652	0.15	0.0	43.73	4.2	3,716	25.36	10	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	31	0.28	0.0	28.00	4.9	4	14.22	0	
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75以上2.50未満	5,409	843	75.00	6,041	1.79	0.0	45.00	4.5	8,287	137.17	48	
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)	1,670	—	—	1,670	100.00	0.0	45.00	1.0	—	—	751	
9	小計	1,945,639	254,197	0.26	2,101,469	0.08	0.1	45.41	3.8	45,093	2.14	840	
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	135,702	5,000	75.00	139,452	0.05	0.0	46.25	2.5	39,099	28.03	33	
2	0.15以上0.25未満	21,977	—	—	21,977	0.16	0.0	45.00	2.1	8,603	39.14	15	
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	2	770	0.05	3	1.79	0.0	39.13	2.4	2	92.44	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	157,682	5,770	64.99	161,432	0.06	0.0	46.08	2.4	47,705	29.55	49	
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	576,219	75,096	51.93	613,906	0.05	0.2	45.16	2.4	139,008	22.64	154	
2	0.15以上0.25未満	434,227	52,652	40.84	449,027	0.16	0.5	44.55	2.2	166,319	37.04	320	
3	0.25以上0.50未満	195,957	8,219	27.08	196,344	0.27	0.7	43.31	2.3	90,892	46.29	230	
4	0.50以上0.75未満	179,847	5,641	15.63	175,568	0.69	0.6	42.96	2.6	137,189	78.14	527	
5	0.75以上2.50未満	263,373	15,911	31.90	285,562	1.71	1.2	44.23	3.3	309,182	108.27	2,121	
6	2.50以上10.00未満	23,308	411	37.33	21,010	4.82	0.1	41.13	2.7	28,911	137.60	416	
7	10.00以上100.00未満	27,186	407	35.68	22,941	16.14	0.1	41.38	2.8	48,556	211.65	1,532	
8	100.00 (デフォルト)	28,129	58	8.57	24,507	100.00	0.1	43.39	2.6	—	—	10,634	
9	小計	1,728,251	158,398	43.55	1,788,868	2.06	3.8	44.32	2.5	920,060	51.43	15,938	
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
2	0.15以上0.25未満	55,129	2,069	20.09	52,876	0.16	0.2	42.67	2.5	17,285	32.69	36	
3	0.25以上0.50未満	375,886	5,043	34.45	365,814	0.26	2.9	40.97	3.7	174,042	47.57	404	
4	0.50以上0.75未満	554,596	3,024	41.75	543,271	0.70	4.1	40.27	4.4	408,340	75.16	1,531	
5	0.75以上2.50未満	690,529	6,243	60.27	672,981	1.78	5.5	40.67	4.3	655,972	97.47	4,899	
6	2.50以上10.00未満	51,110	399	41.52	39,139	4.98	0.6	40.89	3.3	45,010	114.99	797	
7	10.00以上100.00未満	80,391	208	18.00	64,438	16.20	0.6	41.27	3.7	115,921	179.89	4,307	
8	100.00 (デフォルト)	61,928	113	34.20	47,682	100.00	0.4	42.62	3.1	—	—	20,325	
9	小計	1,869,572	17,101	43.40	1,786,206	4.31	14.5	40.75	4.1	1,416,573	79.30	32,302	

(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
特定貸付債権													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
株式等エクスポージャー (PD/LGD方式が適用されるエクスポージャーに限る)													
1	0.00以上0.15未満	121,077	—	—	121,077	0.09	0.0	90.00	5.0	126,307	104.31	107	—
2	0.15以上0.25未満	26,388	—	—	26,388	0.16	0.0	90.00	5.0	32,651	123.73	38	—
3	0.25以上0.50未満	1,138	—	—	1,138	0.27	0.0	90.00	5.0	1,802	158.23	2	—
4	0.50以上0.75未満	136	—	—	136	0.70	0.0	90.00	5.0	537	393.49	0	—
5	0.75以上2.50未満	906	—	—	906	1.79	0.0	90.00	5.0	3,709	409.03	14	—
6	2.50以上10.00未満	58	—	—	58	4.49	0.0	90.00	5.0	234	400.10	2	—
7	10.00以上100.00未満	17	—	—	17	16.14	0.0	90.00	5.0	116	688.00	2	—
8	100.00 (デフォルト)	0	—	—	0	100.00	0.0	90.00	5.0	0	1,125.00	0	—
9	小計	149,724	—	—	149,724	0.12	0.1	90.00	5.0	165,359	110.44	168	—
購入債権 (事業法人等向け)													
1	0.00以上0.15未満	499	—	—	499	0.01	0.0	45.00	5.0	74	14.84	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	499	—	—	499	0.01	0.0	45.00	5.0	74	14.84	0	0
購入債権 (リテール向け)													
1	0.00以上0.15未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(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
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	11,898	59,490	38.15	27,913	1.09	182.1	76.00	—	8,578	30.73	231	—
6	2.50以上10.00未満	15,942	262	296.67	6,757	3.77	23.8	75.99	—	5,111	75.64	193	—
7	10.00以上100.00未満	148	16	39.58	74	46.63	0.2	76.00	—	171	228.60	26	—
8	100.00 (デフォルト)	422	59	41.44	388	100.00	1.1	76.00	—	97	25.00	287	—
9	小計	28,411	59,829	39.29	35,133	2.79	207.4	76.00	—	13,958	39.72	739	507
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	466,729	—	—	466,620	0.10	23.1	40.51	—	46,409	9.94	198	—
2	0.15以上0.25未満	215,856	—	—	215,624	0.17	19.5	37.55	—	29,055	13.47	139	—
3	0.25以上0.50未満	369,268	—	—	369,048	0.43	30.0	39.56	—	102,289	27.71	632	—
4	0.50以上0.75未満	130,827	—	—	130,770	0.73	9.3	39.64	—	52,556	40.18	378	—
5	0.75以上2.50未満	116,643	—	—	99,036	0.94	11.4	37.53	—	44,466	44.89	349	—
6	2.50以上10.00未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	10.00以上100.00未満	15,755	—	—	14,875	11.61	1.8	37.15	—	25,297	170.06	640	—
8	100.00 (デフォルト)	4,174	—	—	3,940	100.00	0.4	39.04	—	1,807	45.87	1,393	—
9	小計	1,319,253	—	—	1,299,915	0.77	95.9	39.39	—	301,882	23.22	3,733	2,233
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	160,257	2,637	26.27	148,182	0.36	13.3	46.28	—	40,265	27.17	248	—
4	0.50以上0.75未満	51,981	39	20.79	51,778	0.69	13.7	37.15	—	16,445	31.76	132	—
5	0.75以上2.50未満	135,272	1,431	21.55	108,369	1.98	57.0	46.47	—	62,837	57.98	995	—
6	2.50以上10.00未満	27,075	258	43.84	15,422	4.81	4.0	44.92	—	10,027	65.01	307	—
7	10.00以上100.00未満	12,597	52	44.00	4,347	13.09	1.6	49.86	—	3,639	83.71	276	—
8	100.00 (デフォルト)	13,668	16	45.40	8,890	100.00	1.3	44.67	—	6,124	68.88	3,482	—
9	小計	400,852	4,435	26.00	336,990	3.93	91.1	44.88	—	139,339	41.34	5,443	3,528
合計 (すべてのポートフォリオ)		7,599,888	499,733	21.11	7,660,243	1.83	413.3	44.05	3.5	3,050,046	39.81	59,215	37,557

- (注) 1. 信用リスク削減手法により保証人のPDを用いてリスク・アセットを算出する明細については、イ欄からハ欄については原債務者の資産区分、ニ欄からラ欄については保証人の資産区分に集計しております。一部のみ保証でカバーされる明細については、原債務者、保証人の資産区分にそれぞれ集計しております。
2. 「適格リボルビング型リテール向けエクスポージャー」「居住用不動産向けエクスポージャー」「その他リテール向けエクスポージャー」については、債権単位でPD推計を行っているため、ヘ欄には「債権の数」を記載しております。

【連結】

2019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	40,866	40,866
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	45,031	45,031
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	2,235,837	2,235,837
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	12,530	12,530
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	17,929	17,929
10	リテール-居住用不動産向けエクスポージャー	315,732	315,732
11	リテール-その他リテール向けエクスポージャー	228,080	228,080
12	株式-FIRB	137,295	137,295
13	株式-AIRB	—	—
14	購入債権-FIRB	67	67
15	購入債権-AIRB	—	—
16	合計	3,033,371	3,033,371

- (注) 1. 信用リスク削減手法として用いられたクレジット・デリバティブはないため、イ欄とロ欄は同額となります。
2. マーケット・ベース方式を適用する株式等エクスポージャーは集計に含めておりません。

2018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	32,046	32,046
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	47,705	47,705
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	2,331,514	2,331,514
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	7,447	7,447
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	18,355	18,355
10	リテール-居住用不動産向けエクスポージャー	307,566	307,566
11	リテール-その他リテール向けエクスポージャー	147,424	147,424
12	株式-FIRB	165,359	165,359
13	株式-AIRB	—	—
14	購入債権-FIRB	74	74
15	購入債権-AIRB	—	—
16	合計	3,057,494	3,057,494

- (注) 1. 信用リスク削減手法として用いられたクレジット・デリバティブはないため、イ欄とロ欄は同額となります。
2. マーケット・ベース方式を適用する株式等エクスポージャーは集計に含めておりません。

【連結】

2019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（スロッシング・クライテリア方式）											
ボ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	1,080	129	50%	1,177	—	—	—	1,177	588	—
	2.5年以上	11,571	3,626	70%	9,901	4,390	—	—	14,291	10,004	57
良（Good）	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	1,372	—	90%	430	441	—	500	1,372	1,235	10
可（Satisfactory）		—	813	115%	610	—	—	—	610	701	17
弱い（Weak）		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト（Default）		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		14,024	4,570	—	12,120	4,831	—	500	17,452	12,530	85
ボ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 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
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	—	—	120%						—	—
可（Satisfactory）		—	—	140%						—	—
弱い（Weak）		—	—	250%						—	—
デフォルト（Default）		—	—	—						—	—
合計		—	—	—						—	—
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 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	
簡易手法-上場株式	90,750	—	300%						90,750	272,252	
簡易手法-非上場株式	362	—	400%						362	1,451	
内部モデル手法	—	—	—						—	—	
合計	91,113	—	—						91,113	273,703	
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百六十六条第一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	—	—	100%						—	—	

イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト	チ	リ	ヌ	ル	ヲ	
特定貸付債権（スロッシング・クライテリア方式）												
ボ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	414	—	50%	—	—	—	—	414	414	207	—
	2.5年以上	8,111	—	70%	4,271	3,839	—	—	8,111	5,677	32	—
良（Good）	2.5年未満	—	—	70%	—	—	—	—	—	—	—	—
	2.5年以上	955	—	90%	467	488	—	—	955	860	7	—
可（Satisfactory）		—	813	115%	610	—	—	—	610	701	17	—
弱い（Weak）		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—	—
デフォルト（Default）		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
合計		9,481	813	—	5,349	4,328	—	414	10,092	7,447	57	—
ボ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・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	リスク・ウェイト	/					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	—	—	120%						—	—	
可（Satisfactory）		—	—	140%						—	—	
弱い（Weak）		—	—	250%						—	—	
デフォルト（Default）		—	—	—						—	—	
合計		—	—	—						—	—	
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		
簡易手法-上場株式	86,037	—	300%	/					86,037	258,113		
簡易手法-非上場株式	382	—	400%						382	1,528		
内部モデル手法	—	—	—						—	—		
合計	86,420	—	—						86,420	259,642		
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百六十六条第一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	—	—	100%	/					—	—		

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】

2019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	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	7,955	17,194			25,149	12,779
2	期待エクスポージャー方式			—	—	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法					—	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法					549,813	1,478
5	エクスポージャー変動推計モデル					—	—
6	合計						14,258

2018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	—	—
	カレント・エクスポージャー方式	7,452	15,856			23,308	12,492
2	期待エクスポージャー方式			—	—	—	—
3	信用リスク削減手法における簡便手法					—	—
4	信用リスク削減手法における包括的手法					471,246	1,870
5	エクスポージャー変動推計モデル					—	—
6	合計						14,362

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

【連結】

2019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	25,149	15,280
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	25,149	15,280

2018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	25,592	17,102
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	25,592	17,102

CCR3：業種別及びリスク・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

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保有しておりません。

【連結】

2019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 効果勘案後)	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	545,516	0.00	0.0	45.00	4.9	991	0.18
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	545,516	0.00	0.0	45.00	4.9	991	0.18
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	18,784	0.05	0.0	45.00	2.3	5,352	28.49
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	18,784	0.05	0.0	45.00	2.3	5,352	28.49
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	236	0.06	0.0	45.00	1.8	46	19.82
2	0.15以上0.25未満	4,233	0.16	0.0	45.00	4.2	2,269	53.62
3	0.25以上0.50未満	2,659	0.26	0.0	45.00	4.1	1,696	63.79
4	0.50以上0.75未満	587	0.68	0.0	45.00	4.4	546	92.98
5	0.75以上2.50未満	2,724	1.75	0.0	45.00	3.7	3,212	117.90
6	2.50以上10.00未満	82	6.67	0.0	45.00	2.9	114	138.90
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00 (デフォルト)	16	100.00	0.0	45.00	2.6	—	—
9	小計	10,539	0.83	0.1	45.00	4.0	7,885	74.82
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	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	118	0.26	0.0	46.00	—	26	22.18
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	3	1.54	0.0	46.00	—	1	55.02
6	2.50以上10.00未満	0	2.70	0.0	46.00	—	0	63.12
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00 (デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	121	0.29	0.0	46.00	—	28	23.08
合計 (全てのポートフォリオ)		574,962	0.01	0.1	45.00	4.8	14,258	2.47

(注) 事業法人向けエクスポージャーには、中堅中小企業向けエクスポージャーを含めております。

2018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 効果勘案後)	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	467,034	0.00	0.0	45.00	5.0	1,070	0.22
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	467,034	0.00	0.0	45.00	5.0	1,070	0.22
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	16,753	0.05	0.0	45.00	2.5	5,101	30.44
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	16,753	0.05	0.0	45.00	2.5	5,101	30.44
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	166	0.06	0.0	45.00	2.9	43	26.41
2	0.15以上0.25未満	5,582	0.16	0.0	45.00	4.3	3,003	53.79
3	0.25以上0.50未満	1,594	0.27	0.0	45.00	4.0	975	61.18
4	0.50以上0.75未満	331	0.70	0.0	45.00	2.6	247	74.61
5	0.75以上2.50未満	2,758	1.79	0.0	45.00	3.9	3,339	121.05
6	2.50以上10.00未満	29	5.23	0.0	45.00	2.8	35	119.38
7	10.00以上100.00未満	211	16.14	0.0	45.00	4.5	524	248.12
8	100.00 (デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	10,675	0.94	0.1	45.00	4.1	8,170	76.53
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	—	—	—	—	—	—	—
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	—	—	—	—
3	0.25以上0.50未満	91	0.26	0.0	46.00	—	20	22.18
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	0	1.01	0.0	46.00	—	0	46.98
6	2.50以上10.00未満	0	5.32	0.0	46.00	—	0	68.31
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00 (デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	91	0.26	0.0	46.00	—	20	22.22
合計 (全てのポートフォリオ)		494,555	0.02	0.1	45.00	4.8	14,362	2.90

(注) 事業法人向けエクスポージャーには、中堅中小企業向けエクスポージャーを含めております。

CCR5：担保の内訳

【連結】

2019年度中間期末

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		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）	—	—	—	—	83,107	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	43,478
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	41,493
6	社債	—	—	—	—	—	2,284
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	83,107	87,257

2018年度中間期末

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		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）	—	—	—	—	74,751	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	—
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	39,193
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	27,512
6	社債	—	—	—	—	—	11,278
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	74,751	77,984

CCR6：クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャーは保有しておりません。

【連結】

2019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)		23
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)	152	3
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	152	3
4	(ii) 派生商品取引 (上場)	—	—
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	100	
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	20
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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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	—	—

2018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)		62
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)	95	1
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	95	1
4	(ii) 派生商品取引 (上場)	—	—
5	(iii) レポ形式の取引	—	—
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	—	—
7	分別管理されている当初証拠金	302	
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	60
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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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】

2019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）	—	—	—	—	—	—	171	—	171
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	171	—	171
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）	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	再証券化	—	—	—	—	—	—	—	—	—

2018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）	—	—	—	—	—	—	291	—	291
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	291	—	291
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）	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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。）

当行はマーケット・リスク相当額を算出していないため、該当ありません。

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及び関連する所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）

当行がオリジネーター又はスポンサーである証券化エクスポージャーは保有していません。

【連結】

2019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		再証券化		合成型 証券化 取引 (小計)	証券化		再証券化					
				裏付と なるリ テール	ホール セール	シニア	非 シニア		裏付と なるリ テール	ホール セール	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	171	171	171	171	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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又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	171	171	171	171	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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又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	29	29	29	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
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又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	2	2	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—		

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		再証券化		合成型 証券化 取引 (小計)	証券化		再証券化					
				裏付と なるリ テール	ホール セール	シニア	非 シニア		裏付と なるリ テール	ホール セール	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	291	291	291	291	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	291	291	291	291	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定により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	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	20	20	20	20	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
13	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定により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	内部格付手法における外部格付準拠方式又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	1	1	1	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
15	内部格付手法における指定関数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	自己資本比率告示第二百四十七条第一項の規定により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	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

【連結】

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2019年度 中間期末	2018年度 中間期末	2019年度 中間期末	2018年度 中間期末
1	上方パラレルシフト	2,599	5,384	2,268	2,390
2	下方パラレルシフト	20,172	35,451	6,879	8,025
3	スティープ化	670	2,181		
4	フラット化	22,209	26,061		
5	短期金利上昇	5,728	5,046		
6	短期金利低下	0	0		
7	最大値	22,209	35,451	6,879	8,025
		ホ		ハ	
		2019年度中間期末		2018年度中間期末	
8	Tier1資本の額	515,802		508,602	

【単体】

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2019年度 中間期末	2018年度 中間期末	2019年度 中間期末	2018年度 中間期末
1	上方パラレルシフト	2,599	5,384	2,268	2,390
2	下方パラレルシフト	21,354	36,636	6,854	8,003
3	スティープ化	670	2,181		
4	フラット化	22,398	26,281		
5	短期金利上昇	5,374	4,713		
6	短期金利低下	0	0		
7	最大値	22,398	36,636	6,854	8,003
		ホ		ハ	
		2019年度中間期末		2018年度中間期末	
8	Tier1資本の額	490,901		483,705	

CCyB1：カウンター・シクリカル・バッファ比率に係る国又は地域別の状況

【連結】

2019年度中間期末

(単位：百万円、%)

	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いた当該国又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・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
フランス	0.25%	11,371		
香港	2.50%	2,542		
スウェーデン	2.50%	1,573		
英国	1.00%	12,083		
小計		27,571		
合計		3,991,701	0.00%	—

2018年度中間期末

(単位：百万円、%)

	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いた当該国又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・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
小計				
合計				

(注) 開示告示附則(平成31年金融庁告示第5号)第2条第4項の規定に基づき、前中間連結会計期間に係る開示を省略しております。