

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)

	2021年度中間期末	2022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）	134,103	116,225
マンドート方式（自己資本比率告示第167条第7項）	15,119	25,817
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	149,222	142,043

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	
		2022年度 中間期末	2021年度 中間期末	2022年度 中間期末	2021年度 中間期末
1	信用リスク	2,990,953	3,168,957	252,913	267,960
2	うち、標準的手法適用分	84,084	91,344	6,726	7,307
3	うち、内部格付手法適用分	2,841,148	3,009,218	240,929	255,181
	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	65,721	68,394	5,257	5,471
4	カウンターパーティ信用リスク	45,842	36,730	3,784	3,031
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	14,111	14,144	1,196	1,199
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	21,336	17,286	1,706	1,382
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32	26	2	2
	その他	10,360	5,273	878	447
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	428,593	504,604	36,344	42,790
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）	139,202	185,912	11,804	15,765
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）	103,270	60,476	8,757	5,128
	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	14,310	6,640	1,144	531
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	14,310	6,640	1,144	531
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	157,383	154,017	12,590	12,321
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	157,383	154,017	12,590	12,321
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	51,379	8,334	4,356	706
	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	3,930,936	4,125,673	331,697	348,236

(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	
		2022年度 中間期末	2021年度 中間期末	2022年度 中間期末	2021年度 中間期末
1	信用リスク	2,935,574	3,117,354	248,594	263,962
2	うち、標準的手法適用分	8,746	15,856	699	1,268
3	うち、内部格付手法適用分	2,864,278	3,036,370	242,890	257,484
	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	62,549	65,126	5,003	5,210
4	カウンターパーティ信用リスク	45,842	36,730	3,784	3,031
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	14,111	14,144	1,196	1,199
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	21,336	17,286	1,706	1,382
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32	26	2	2
	その他	10,360	5,273	878	447
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	422,878	502,360	35,860	42,600
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）	139,761	186,674	11,851	15,830
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）	103,149	60,476	8,747	5,128
	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	14,310	6,640	1,144	531
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	14,310	6,640	1,144	531
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	146,868	144,305	11,749	11,544
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,868	144,305	11,749	11,544
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	48,324	9,276	4,097	786
	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	3,856,710	4,063,817	325,830	343,415

(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】

2022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	136,292	5,667,649	45,403	5,758,538
2	有価証券（うち負債性のもの）	80	2,053,975	—	2,054,055
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	3,480	1,615,067	4,450	1,614,096
4	オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）	139,852	9,336,692	49,854	9,426,691
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	63	8,621	22	8,662
6	コミットメント等	—	106,586	168	106,418
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）	63	115,208	190	115,081
合計					
8	合計（4+7）	139,916	9,451,901	50,044	9,541,773

- (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し可能なコミットメントを除く。）を計上しております。

2021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	144,278	5,529,019	47,576	5,625,721
2	有価証券（うち負債性のもの）	98	2,121,088	—	2,121,186
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	3,335	2,516,901	4,059	2,516,176
4	オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）	147,711	10,167,009	51,636	10,263,085
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	35	8,959	31	8,963
6	コミットメント等	—	118,162	192	117,970
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5+6）	35	127,122	223	126,934
合計					
8	合計（4+7）	147,747	10,294,131	51,859	10,390,019

- (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し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】

2022年度中間期末

(単位：百万円)

項番		額
1	2021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	143,736
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	2022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）	139,852

(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。

2021年度中間期末

(単位：百万円)

項番		額
1	2020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	156,154
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	2021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）	147,711

(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】

2022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	3,622,315	2,136,222	1,015,640	436,271	—
2	有価証券（負債性のもの）	2,036,570	17,485	—	17,077	—
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	1,613,455	641	297	131	—
4	合計（1+2+3）	7,272,341	2,154,350	1,015,938	453,480	—
5	うちデフォルトしたもの	47,465	60,740	20,178	27,329	—

(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。

2021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	3,730,433	1,895,288	1,029,616	428,452	—
2	有価証券（負債性のもの）	2,099,238	21,947	—	21,795	—
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	2,515,599	577	288	129	—
4	合計（1+2+3）	8,345,271	1,917,813	1,029,905	450,377	—
5	うちデフォルトしたもの	85,195	30,822	22,557	26,836	—

(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】

2022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							
		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	1	—	1	—	—	—	—	—		
2	日本国政府及び日本銀行向け	3	—	3	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
5	我が国の地方公共団体向け	190	—	190	—	—	—	—	—		
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	—	—	—	—	—	—	—	—		
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	—	7	—	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	12,960	—	12,960	—	2,592	—	2,592	20.00		
12	法人等向け	70,743	—	70,743	—	70,739	—	70,739	99.99		
13	中小企業等向け及び個人向け	11,359	—	11,359	—	8,519	—	8,519	75.00		
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。）	1,496	—	1,496	—	2,224	—	2,224	148.66		
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	96,832	—	96,832	—	84,084	—	84,084	86.83		

2021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							
		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	1	—	1	—	—	—	—	—		
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
4	国際決済銀行等向け	—	—	—	—	—	—	—	—		
5	我が国の地方公共団体向け	224	—	224	—	—	—	—	—		
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	—	—	—	—	—	—	—	—		
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	—	7	—	7	10.00		
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	7,722	—	7,722	—	1,544	—	1,544	19.99		
12	法人等向け	78,772	—	78,772	—	78,767	—	78,767	99.99		
13	中小企業等向け及び個人向け	11,021	—	11,021	—	8,266	—	8,266	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。）	1,842	—	1,842	—	2,758	—	2,758	149.73		
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	99,661	—	99,661	—	91,344	—	91,344	91.65		

【連結】

2022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)										合計		
			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		1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1
2	日本国政府及び日本銀行向け		3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	国際決済銀行等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け		190	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	190
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		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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		—	—	12,960	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12,960
12	法人等向け		—	—	4	—	1	—	70,738	—	—	—	—	—	70,743
13	中小企業等向け及び個人向け		—	—	—	—	—	11,359	—	—	—	—	—	—	11,359
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。）		—	—	—	—	20	—	—	1,476	—	—	—	—	1,496
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		195	76	12,964	—	21	11,359	70,738	1,476	—	—	—	—	96,832

2021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)										合計		
			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		1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1
3	外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	国際決済銀行等向け		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	我が国の地方公共団体向け		224	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	224
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		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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		—	—	7,722	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7,722
12	法人等向け		—	—	—	—	9	—	78,763	—	—	—	—	—	78,772
13	中小企業等向け及び個人向け		—	—	—	—	—	11,021	—	—	—	—	—	—	11,021
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。）		—	—	—	—	4	—	—	1,837	—	—	—	—	1,842
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		226	76	7,722	—	14	11,021	78,763	1,837	—	—	—	—	99,661

【連結】

2022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	ヲ 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	3,439,466	208,404	0.00	3,798,852	0.00	0.1	45.50	4.5	81,790	2.15	73	
2	0.15以上0.25未満	—	—	—	7,103	0.16	0.0	43.00	4.9	1,047	14.75	4	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	2	0.27	0.0	28.00	4.7	0	14.06	0	
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75以上2.50未満	1,737	—	—	1,737	1.65	0.0	45.00	2.7	1,951	112.33	12	
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)	1,590	—	—	1,590	100.00	0.0	45.00	5.0	—	—	715	
9	小計	3,442,794	208,404	0.00	3,809,286	0.04	0.1	45.49	4.5	84,790	2.22	806	201
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	145,932	—	—	145,932	0.04	0.0	46.38	2.1	31,993	21.92	30	
2	0.15以上0.25未満	12,802	724	75.00	13,346	0.15	0.0	45.00	1.9	4,561	34.17	9	
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	4	770	0.05	4	1.65	0.0	41.08	2.0	4	90.63	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	158,739	1,494	36.36	159,282	0.05	0.0	46.27	2.1	36,558	22.95	39	9
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	709,403	88,484	43.87	747,965	0.04	0.2	45.72	2.6	165,456	22.12	159	
2	0.15以上0.25未満	674,832	68,056	40.47	681,908	0.19	1.2	44.24	2.3	277,804	40.73	580	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	17,631	0.35	0.0	73.77	1.0	2,249	12.76	46	
4	0.50以上0.75未満	111,170	5,345	22.41	156,367	0.68	0.4	42.89	3.4	103,277	66.04	459	
5	0.75以上2.50未満	231,745	5,775	50.90	213,317	1.64	1.0	42.18	3.3	237,740	111.44	1,484	
6	2.50以上10.00未満	47,085	2,297	71.75	42,425	4.49	0.1	42.93	2.5	58,986	139.03	818	
7	10.00以上100.00未満	29,555	1,250	0.60	22,645	14.80	0.2	40.78	3.2	46,974	207.43	1,366	
8	100.00 (デフォルト)	47,244	270	0.00	41,520	100.00	0.1	43.28	2.6	—	—	17,972	
9	小計	1,851,036	171,480	42.08	1,923,782	2.75	3.6	44.66	2.7	892,489	46.39	22,888	25,131
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	750	—	—	750	0.05	0.0	45.00	2.4	139	18.53	0	
2	0.15以上0.25未満	430,466	7,175	37.68	388,816	0.23	2.7	41.40	3.6	171,956	44.22	369	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
4	0.50以上0.75未満	450,695	3,255	26.67	422,395	0.66	3.0	40.35	4.5	314,298	74.40	1,142	
5	0.75以上2.50未満	561,306	3,794	49.50	501,911	1.65	4.1	41.02	4.2	485,902	96.81	3,397	
6	2.50以上10.00未満	107,102	392	18.13	79,007	4.49	0.9	40.40	3.9	90,210	114.17	1,435	
7	10.00以上100.00未満	111,568	349	29.46	76,211	14.80	0.8	40.95	3.8	133,236	174.82	4,619	
8	100.00 (デフォルト)	69,040	211	8.02	51,298	100.00	0.4	43.04	2.7	—	—	22,083	
9	小計	1,730,931	15,178	37.17	1,520,392	5.13	12.2	40.96	4.0	1,195,742	78.64	33,047	15,174

(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	ヲ 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	80,456	—	—	80,456	0.10	0.0	90.00	5.0	80,866	100.51	74	—
2	0.15以上0.25未満	9,514	—	—	9,514	0.16	0.0	90.00	5.0	12,214	128.37	14	—
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	187	—	—	187	0.67	0.0	90.00	5.0	630	336.25	1	—
5	0.75以上2.50未満	2,005	—	—	2,005	1.65	0.0	90.00	5.0	9,431	470.23	29	—
6	2.50以上10.00未満	707	—	—	707	4.32	0.0	90.00	5.0	2,794	394.82	27	—
7	10.00以上100.00未満	30	—	—	30	14.80	0.0	90.00	5.0	276	910.87	4	—
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	92,902	—	—	92,902	0.18	0.1	90.00	5.0	106,214	114.32	151	—

購入債権 (事業法人等向け)

1	0.00以上0.15未満	510	—	—	510	0.01	0.0	45.00	5.0	75	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	510	—	—	510	0.01	0.0	45.00	5.0	75	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	ヲ 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	10,392	27,119	39.19	12,949	1.11	51.2	74.00	—	3,916	30.24	106	—
6	2.50以上10.00未満	14,065	250	232.52	5,068	3.50	20.1	73.99	—	3,542	69.89	131	—
7	10.00以上100.00未満	92	13	34.60	40	58.31	0.1	74.00	—	81	201.49	17	—
8	100.00 (デフォルト)	260	66	33.16	203	100.00	0.6	74.00	—	50	25.00	146	—
9	小計	24,811	27,449	40.93	18,261	3.00	72.1	73.99	—	7,591	41.57	402	270
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	602,695	—	—	602,351	0.08	38.1	39.80	—	49,850	8.27	206	—
2	0.15以上0.25未満	241,488	—	—	241,438	0.22	14.3	40.94	—	42,572	17.63	217	—
3	0.25以上0.50未満	351,775	—	—	351,585	0.42	30.2	39.68	—	95,891	27.27	587	—
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	203,544	—	—	145,423	0.75	14.8	39.97	—	60,204	41.39	437	—
6	2.50以上10.00未満	17,762	—	—	16,712	8.56	1.6	39.41	—	28,047	167.82	563	—
7	10.00以上100.00未満	701	—	—	645	48.50	0.0	39.21	—	1,299	201.31	122	—
8	100.00 (デフォルト)	3,495	—	—	3,267	100.00	0.3	40.68	—	1,561	47.77	1,204	—
9	小計	1,421,463	—	—	1,361,424	0.63	99.6	39.98	—	279,427	20.52	3,341	1,768
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	152,824	1,595	28.99	110,833	0.29	8.2	45.28	—	25,945	23.40	146	—
4	0.50以上0.75未満	198,304	13	21.25	195,113	0.65	26.7	46.79	—	75,772	38.83	594	—
5	0.75以上2.50未満	181,350	1,190	22.60	144,281	1.90	37.5	45.31	—	82,001	56.83	1,243	—
6	2.50以上10.00未満	42,710	270	33.82	13,818	5.34	8.8	46.42	—	9,481	68.61	337	—
7	10.00以上100.00未満	429	—	—	386	79.46	0.0	45.96	—	270	69.94	140	—
8	100.00 (デフォルト)	14,777	39	87.19	10,629	100.00	1.2	44.83	—	7,665	72.12	4,151	—
9	小計	590,397	3,109	27.68	475,062	3.37	82.7	45.93	—	201,137	42.33	6,614	3,921
合計 (すべてのポートフォリオ)		9,313,587	427,117	21.18	9,360,906	1.69	270.7	44.32	3.9	2,804,027	29.95	67,293	46,477

- (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、ニ欄からヲ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。

2021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	ヲ 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	4,431,448	201,823	0.00	4,805,180	0.00	0.1	45.39	4.6	82,456	1.71	74	
2	0.15以上0.25未満	1,625	—	—	9,326	0.16	0.0	43.33	4.3	1,604	17.20	6	
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	3	0.28	0.0	28.00	5.0	0	14.20	0	
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
5	0.75以上2.50未満	2,248	356	75.00	2,516	1.70	0.0	45.00	3.9	3,226	128.21	19	
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)	1,610	—	—	1,610	100.00	0.0	45.00	5.0	—	—	724	
9	小計	4,436,931	202,179	0.14	4,818,636	0.03	0.1	45.38	4.6	87,287	1.81	824	
金融機関等向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	120,680	—	—	120,680	0.05	0.0	46.53	2.7	37,970	31.46	31	
2	0.15以上0.25未満	12,885	—	—	12,885	0.15	0.0	45.00	1.3	3,743	29.05	8	
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	5	770	0.05	5	1.70	0.0	41.89	2.4	5	99.17	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	133,571	770	0.05	133,572	0.06	0.0	46.38	2.6	41,719	31.23	40	
事業法人向けエクスポージャー													
1	0.00以上0.15未満	601,883	87,328	48.35	643,396	0.05	0.2	45.55	2.3	146,815	22.81	163	
2	0.15以上0.25未満	330,660	48,954	46.67	347,397	0.15	0.4	44.43	2.1	121,181	34.88	232	
3	0.25以上0.50未満	282,151	16,718	33.35	292,686	0.25	0.7	46.03	2.4	135,773	46.38	358	
4	0.50以上0.75未満	140,599	4,296	24.62	132,867	0.67	0.5	42.84	2.8	105,009	79.03	386	
5	0.75以上2.50未満	246,863	13,373	54.14	261,876	1.59	1.1	42.60	3.3	272,349	103.99	1,781	
6	2.50以上10.00未満	50,678	1,623	69.89	45,335	4.46	0.2	42.84	2.7	63,623	140.34	866	
7	10.00以上100.00未満	31,673	335	53.90	25,603	15.08	0.1	41.68	3.0	54,084	211.23	1,609	
8	100.00 (デフォルト)	54,193	1,168	3.02	48,712	100.00	0.2	42.92	2.6	—	—	20,908	
9	小計	1,738,704	173,800	46.20	1,797,875	3.41	3.6	44.59	2.5	898,837	49.99	26,307	
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	1.8	85	17.12	0	
2	0.15以上0.25未満	43,451	2,162	32.46	39,782	0.15	0.1	42.92	2.4	12,478	31.36	25	
3	0.25以上0.50未満	373,561	4,682	43.21	336,247	0.25	2.4	41.18	3.7	156,822	46.63	346	
4	0.50以上0.75未満	463,573	2,895	30.26	432,461	0.67	3.1	40.24	4.5	324,555	75.04	1,183	
5	0.75以上2.50未満	608,396	6,647	54.52	542,797	1.69	4.5	40.85	4.2	527,221	97.13	3,769	
6	2.50以上10.00未満	133,033	803	30.49	98,535	4.63	1.1	40.82	3.8	114,738	116.44	1,863	
7	10.00以上100.00未満	122,720	442	23.37	87,101	15.08	0.9	41.00	3.9	153,053	175.71	5,385	
8	100.00 (デフォルト)	69,697	363	0.00	52,218	100.00	0.4	42.96	2.8	—	—	22,438	
9	小計	1,814,935	17,996	42.08	1,589,645	5.22	13.0	40.88	4.1	1,288,956	81.08	35,012	

(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	ヲ 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	102,348	—	—	102,348	0.10	0.0	90.00	5.0	103,625	101.24	96	—
2	0.15以上0.25未満	8,943	—	—	8,943	0.15	0.0	90.00	5.0	10,766	120.38	12	—
3	0.25以上0.50未満	1,142	—	—	1,142	0.25	0.0	90.00	5.0	1,777	155.58	2	—
4	0.50以上0.75未満	230	—	—	230	0.68	0.0	90.00	5.0	746	323.90	1	—
5	0.75以上2.50未満	2,992	—	—	2,992	1.70	0.0	90.00	5.0	13,828	462.09	45	—
6	2.50以上10.00未満	742	—	—	742	4.38	0.0	90.00	5.0	2,945	396.69	29	—
7	10.00以上100.00未満	268	—	—	268	15.08	0.0	90.00	5.0	1,795	668.16	36	—
8	100.00 (デフォルト)	17	—	—	17	100.00	0.0	90.00	5.0	200	1,125.00	16	—
9	小計	116,686	—	—	116,686	0.22	0.1	90.00	5.0	135,685	116.28	239	—
購入債権 (事業法人等向け)													
1	0.00以上0.15未満	422	—	—	422	0.01	0.0	45.00	5.0	62	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	422	—	—	422	0.01	0.0	45.00	5.0	62	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	ヲ 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	10,799	38,804	38.15	17,971	1.05	95.6	75.00	—	5,315	29.57	142	—
6	2.50以上10.00未満	13,740	246	246.17	5,242	3.57	19.9	74.99	—	3,768	71.87	140	—
7	10.00以上100.00未満	98	15	26.80	41	48.19	0.1	75.00	—	93	223.73	15	—
8	100.00 (デフォルト)	265	56	35.16	236	100.00	0.6	75.00	—	59	25.00	172	—
9	小計	24,903	39,122	39.45	23,492	2.69	116.4	75.00	—	9,236	39.31	470	318
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	517,040	—	—	516,826	0.11	28.0	40.19	—	52,980	10.25	229	—
2	0.15以上0.25未満	94,564	—	—	94,448	0.20	10.8	36.91	—	13,989	14.81	69	—
3	0.25以上0.50未満	354,096	—	—	353,956	0.39	25.2	40.46	—	93,462	26.40	560	—
4	0.50以上0.75未満	238,421	—	—	238,281	0.67	19.9	39.24	—	90,127	37.82	634	—
5	0.75以上2.50未満	120,930	—	—	84,103	1.05	10.5	38.11	—	41,753	49.64	339	—
6	2.50以上10.00未満	14,757	—	—	13,982	8.87	1.7	37.73	—	22,808	163.12	467	—
7	10.00以上100.00未満	685	—	—	620	49.07	0.0	40.36	—	1,277	205.73	122	—
8	100.00 (デフォルト)	3,410	—	—	3,129	100.00	0.3	39.97	—	1,473	47.09	1,133	—
9	小計	1,343,907	—	—	1,305,348	0.71	96.7	39.69	—	317,873	24.35	3,558	1,953
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	156,361	1,798	28.05	115,828	0.30	8.4	45.24	—	27,772	23.97	158	—
4	0.50以上0.75未満	200,899	18	21.12	197,415	0.67	25.6	44.47	—	74,134	37.55	591	—
5	0.75以上2.50未満	178,999	1,461	22.30	141,704	2.01	38.3	45.33	—	81,490	57.50	1,289	—
6	2.50以上10.00未満	48,492	288	36.04	18,653	5.87	10.0	44.29	—	12,351	66.21	466	—
7	10.00以上100.00未満	396	—	—	350	80.21	0.0	47.18	—	244	69.68	132	—
8	100.00 (デフォルト)	15,242	3	20.00	11,028	100.00	1.3	44.42	—	7,858	71.25	4,270	—
9	小計	600,392	3,569	26.29	484,981	3.49	83.8	44.90	—	203,853	42.03	6,910	4,414
合計 (すべてのポートフォリオ)		10,210,455	437,439	23.89	10,270,661	1.68	314.0	44.39	4.0	2,983,513	29.04	73,363	48,704

(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、ニ欄からヲ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。

CR7：内部格付手法-信用リスク削減手法として用いられるクレジット・デリバティブが信用リスク・アセットの額に与える影響

【連結】

2022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	47,875	47,875
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	36,558	36,558
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	2,084,156	2,084,156
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	37,121	37,121
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	9,837	9,837
10	リテール-居住用不動産向けエクスポージャー	302,898	302,898
11	リテール-その他リテール向けエクスポージャー	216,410	216,410
12	株式-FIRB	106,214	106,214
13	株式-AIRB	—	—
14	購入債権-FIRB	75	75
15	購入債権-AIRB	—	—
16	合計	2,841,148	2,841,148

(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。

2021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	47,972	47,972
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	41,719	41,719
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	2,193,734	2,193,734
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	25,705	25,705
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	11,661	11,661
10	リテール-居住用不動産向けエクスポージャー	333,056	333,056
11	リテール-その他リテール向けエクスポージャー	219,620	219,620
12	株式-FIRB	135,685	135,685
13	株式-AIRB	—	—
14	購入債権-FIRB	62	62
15	購入債権-AIRB	—	—
16	合計	3,009,218	3,009,218

(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】

2022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	1,130	3,960	50%	1,928	—	—	2,173	4,101	2,050	—	
	2.5年以上	39,870	6,405	70%	36,567	2,937	—	5,169	44,674	31,271	178	
良（Good）	2.5年未満	495	—	70%	—	—	—	495	495	346	1	
	2.5年以上	1,518	—	90%	320	1,198	—	—	1,518	1,366	12	
可（Satisfactory）		1,202	813	115%	610	—	—	1,202	1,813	2,084	50	
弱い（Weak）		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—	
デフォルト（Default）		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
合計		44,217	11,179	—	39,426	4,135	—	9,040	52,602	37,121	243	
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		
簡易手法-上場株式	142,730	—	300%						142,730	428,190		
簡易手法-非上場株式	100	—	400%						100	402		
内部モデル手法	—	—	—						—	—		
合計	142,831	—	—						142,831	428,593		
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 (スロットティング・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	—	3,863	50%	1,034	—	—	1,863	2,897	1,448	—					
	2.5年以上	26,537	3,992	70%	23,378	3,089	—	3,064	29,531	20,672	118					
良 (Good)	2.5年未満	500	—	70%	—	—	—	500	500	350	2					
	2.5年以上	1,118	—	90%	357	760	—	—	1,118	1,006	8					
可 (Satisfactory)		1,326	813	115%	610	—	—	1,326	1,937	2,227	54					
弱い (Weak)		—	—	250%	—	—	—	—	—	—	—					
デフォルト (Default)		—	—	—	—	—	—	—	—	—	—					
合計		29,482	8,669	—	25,380	3,850	—	6,754	35,984	25,705	183					
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	168,056	—	300%	/						168,056	504,170	/				
簡易手法-非上場株式	108	—	400%						108	434						
内部モデル手法	—	—	—						—	—						
合計	168,165	—	—						168,165	504,604						
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】

2022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	7,597	21,163			28,761	14,111
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					1,097,671	10,360
5	エクスポージャー変動推計モデル					—	—
6	合計						24,472

2021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	7,601	20,858			28,459	14,144
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					1,944,369	5,273
5	エクスポージャー変動推計モデル					—	—
6	合計						19,417

CCR2：CVAリスクに対する資本賦課

【連結】

2022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バリュウ・アット・リスクの額 (乗数適用後)		—
3	(ii) CVAストレス・バリュウ・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	28,761	21,336
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	28,761	21,336

2021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バリュウ・アット・リスクの額 (乗数適用後)		—
3	(ii) CVAストレス・バリュウ・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	28,459	17,286
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	28,459	17,286

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いません。

【連結】

2022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	1,070,850	0.00	0.0	45.00	5.0	1,318	0.12
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	1,070,850	0.00	0.0	45.00	5.0	1,318	0.12
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	38,109	0.04	0.0	45.00	3.2	12,265	32.18
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	38,109	0.04	0.0	45.00	3.2	12,265	32.18
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,386	0.05	0.0	45.00	0.7	250	10.50
2	0.15以上0.25未満	9,863	0.19	0.0	45.00	3.0	4,655	47.19
3	0.25以上0.50未満	—	—	—	—	—	—	—
4	0.50以上0.75未満	2,217	0.67	0.0	45.00	4.7	2,218	100.03
5	0.75以上2.50未満	2,161	1.65	0.0	45.00	4.4	2,705	125.17
6	2.50以上10.00未満	422	6.00	0.0	45.00	3.0	656	155.15
7	10.00以上100.00未満	191	14.80	0.0	45.00	4.4	368	192.42
8	100.00 (デフォルト)	85	100.00	0.0	45.00	3.0	—	—
9	小計	17,328	1.20	0.1	45.00	3.1	10,854	62.64
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	138	0.25	0.0	45.00	—	29	21.15
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	0	0.97	0.0	45.00	—	0	45.17
6	2.50以上10.00未満	0	2.64	0.0	45.00	—	0	61.50
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00 (デフォルト)	5	100.00	0.0	45.00	—	4	75.00
9	小計	144	4.24	0.0	45.00	—	33	23.36
合計	(全てのポートフォリオ)	1,126,433	0.02	0.2	45.00	4.9	24,472	2.17

(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。

2021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	1,922,441	0.00	0.0	44.99	5.0	1,050	0.05
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	1,922,441	0.00	0.0	44.99	5.0	1,050	0.05
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	25,848	0.06	0.0	45.00	2.2	7,158	27.69
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	25,848	0.06	0.0	45.00	2.2	7,158	27.69
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	4,274	0.06	0.0	45.00	0.2	488	11.41
2	0.15以上0.25未満	12,356	0.15	0.0	45.00	1.0	3,624	29.32
3	0.25以上0.50未満	3,417	0.25	0.0	45.00	4.0	2,115	61.89
4	0.50以上0.75未満	1,328	0.68	0.0	45.00	4.0	1,168	87.94
5	0.75以上2.50未満	2,431	1.70	0.0	45.00	3.8	2,920	120.11
6	2.50以上10.00未満	263	5.79	0.0	45.00	3.1	377	143.31
7	10.00以上100.00未満	240	15.08	0.0	45.00	4.4	467	193.89
8	100.00 (デフォルト)	55	100.00	0.0	45.00	3.5	—	—
9	小計	24,370	0.76	0.1	45.00	1.8	11,161	45.80
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	137	0.25	0.0	45.00	—	29	21.15
4	0.50以上0.75未満	—	—	—	—	—	—	—
5	0.75以上2.50未満	9	0.99	0.0	45.00	—	4	45.57
6	2.50以上10.00未満	22	2.69	0.0	45.00	—	13	61.71
7	10.00以上100.00未満	—	—	—	—	—	—	—
8	100.00 (デフォルト)	—	—	—	—	—	—	—
9	小計	169	0.61	0.0	45.00	—	47	27.86
合計 (全てのポートフォリオ)		1,972,829	0.01	0.2	44.99	4.9	19,417	0.98

(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】

2022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）	—	—	—	—	160,775	—
2	現金（外国通貨）	—	—	—	—	135,584	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	164,330
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	29,609
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	111,733
6	社債	—	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	296,360	305,672

2021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）	—	—	—	—	571,554	—
2	現金（外国通貨）	—	—	—	—	129,851	—
3	国内ソブリン債	—	—	—	—	—	583,941
4	その他ソブリン債	—	—	—	—	—	46,798
5	政府関係機関債	—	—	—	—	—	90,299
6	社債	—	—	—	—	—	—
7	株式	—	—	—	—	—	—
8	その他担保	—	—	—	—	—	—
9	合計	—	—	—	—	701,406	721,040

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】

2022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)		32
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)	638	12
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	638	12
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tingが承認された場合のネットting・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tingが承認された場合のネットting・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	—	—

2021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)		26
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)	341	6
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	341	6
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tingが承認された場合のネットting・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tingが承認された場合のネットting・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】

2022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)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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)	—	—	—	—	—	—	71,554	—	71,554
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	71,554	—	71,554
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	—	—	—	—	—	—	—	—	—

2021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)	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—	—	—	—	—	—	—
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)	—	—	—	—	—	—	33,202	—	33,202
7	事業法人向けローン	—	—	—	—	—	—	33,202	—	33,202
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。

SEC4：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（自金融機関が投資家である場合）

【連結】

2022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	71,554	71,554	71,554	-	71,554	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	71,554	71,554	71,554	-	71,554	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	14,310	14,310	14,310	-	14,310	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	1,144	1,144	1,144	-	1,144	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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)				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	33,202	33,202	33,202	-	33,202	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
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	33,202	33,202	33,202	-	33,202	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
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	6,640	6,640	6,640	-	6,640	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
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	531	531	531	-	531	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

【連結】

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年度 中間期末	2021年度 中間期末	2022年度 中間期末	2021年度 中間期末
1	上方パラレルシフト	37,358	50,332	5,300	10,071
2	下方パラレルシフト	0	0	1,285	0
3	スティープ化	19,438	28,665		
4	フラット化	0	31		
5	短期金利上昇	6,138	7,611		
6	短期金利低下	0	0		
7	最大値	37,358	50,332	5,300	10,071
		ホ		ハ	
		2022年度中間期末		2021年度中間期末	
8	Tier1資本の額	458,463		523,786	

【単体】

(単位：百万円)

項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年度 中間期末	2021年度 中間期末	2022年度 中間期末	2021年度 中間期末
1	上方パラレルシフト	36,242	49,194	5,300	10,088
2	下方パラレルシフト	0	0	1,239	0
3	スティープ化	18,900	28,152		
4	フラット化	0	31		
5	短期金利上昇	5,824	7,268		
6	短期金利低下	0	0		
7	最大値	36,242	49,194	5,300	10,088
		ホ		ハ	
		2022年度中間期末		2021年度中間期末	
8	Tier1資本の額	421,425		491,949	

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】

2022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
香港	1.00%	2,343		
ルクセンブルク	0.50%	3,674		
スウェーデン	1.00%	511		
小計		6,529		
合計		3,817,546	0.00%	—

2021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
香港	1.00%	2,277		
ルクセンブルク	0.50%	4,312		
小計		6,590		
合計		4,023,723	0.00%	—