

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結:2021年3月末】(別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式 の該 当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年 3月末	2020年 12月末	2021年 3月末	2020年 12月末
1	信用リスク	2,772,751	2,769,020	234,741	234,411
2	うち、標準的手法適用分	33,679	33,639	2,694	2,691
3	うち、内部格付手法適用分	2,691,899	2,685,309	228,273	227,714
	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	47,171	50,071	3,773	4,005
4	カウンターパーティ信用リスク	79,664	75,858	6,514	6,211
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	16,086	1,517	1,364
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	40,674	3,641	3,253
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,668	5,434	373	434
	その他	11,586	13,663	982	1,158
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	496,253	434,805	42,082	36,871
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)	328,181	286,633	27,829	24,306
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)	-	-	-	-
	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1250%)	252	1,489	20	119
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	106,507	7,971	8,520
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	106,507	7,971	8,520
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%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	153,043	154,209	12,243	12,336
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	153,043	154,209	12,243	12,336
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	12,381	12,074	1,045	1,018
	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	3,942,171	3,840,599	332,448	323,795

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結:2021年3月末】(別紙様式第八号第二面) (単位:百万円)

CR8:内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,168,222	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	8,981
3		ポートフォリオの質	59,005
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,236,208	

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【単体：2021年3月末】(別紙様式第八号第一面)

(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	
		2021年 3月末	2020年 12月末	2021年 3月末	2020年 12月末
1	信用リスク	2,760,036	2,756,864	233,856	233,577
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,719,515	2,714,225	230,614	230,166
	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	42,639	3,241	3,411
4	カウンターパーティ信用リスク	79,664	75,858	6,514	6,211
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	16,086	1,517	1,364
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	40,674	3,641	3,253
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,668	5,434	373	434
	その他	11,586	13,663	982	1,158
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	496,213	434,765	42,078	36,868
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	285,683	27,744	24,225
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)	-	-	-	-
	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1250%)	-	-	-	-
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	106,507	7,971	8,520
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	106,507	7,971	8,520
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%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	145,503	11,553	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	144,422	145,503	11,553	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	10,253	9,808	869	831
	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	3,917,411	3,814,990	330,589	321,875