

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：2020年9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	
		2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 9月末	2020年 6月末
1	信用リスク	2,807,434	2,783,326	237,679	235,629
2	うち、標準的手法適用分	33,490	33,806	2,679	2,704
3	うち、内部格付手法適用分	2,726,012	2,700,600	231,165	229,010
	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	47,931	48,919	3,834	3,913
4	カウンターパーティ信用リスク	86,881	60,838	7,140	5,007
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	24,001	20,500	2,035	1,738
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	41,441	25,536	3,315	2,042
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,768	6,075	461	486
	その他	15,669	8,725	1,328	739
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	405,474	402,662	34,384	34,145
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)	261,851	279,478	22,205	23,699
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%)	1,468	1,455	117	116
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	105,773	107,240	8,461	8,579
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	105,773	107,240	8,461	8,579
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	154,209	154,773	12,336	12,381
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	154,209	154,773	12,336	12,381
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	12,071	10,917	1,018	920
	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	3,835,164	3,800,693	323,344	320,479

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：2020年9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	3,150,628	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	22,604
3		ポートフォリオの質	6,865
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	3,180,098	

(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：2020年9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	
		2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 9月末	2020年 6月末
1	信用リスク	2,797,347	2,773,442	237,014	234,982
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,755,492	2,730,723	233,665	231,565
	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	41,854	42,719	3,348	3,417
4	カウンターパーティ信用リスク	86,881	60,838	7,140	5,007
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	24,001	20,500	2,035	1,738
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	41,441	25,536	3,315	2,042
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,768	6,075	461	486
	その他	15,669	8,725	1,328	739
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	405,434	402,622	34,380	34,142
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)	261,048	278,704	22,136	23,634
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	105,773	107,240	8,461	8,579
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	105,773	107,240	8,461	8,579
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	145,503	146,058	11,640	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	145,503	146,058	11,640	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	9,748	8,739	826	741
	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	3,811,736	3,777,646	321,601	318,771