

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12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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	2,769,020	2,807,434	234,411	237,679
2	うち、標準的手法適用分	33,639	33,490	2,691	2,679
3	うち、内部格付手法適用分	2,685,309	2,726,012	227,714	231,165
	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	50,071	47,931	4,005	3,834
4	カウンターパーティ信用リスク	75,858	86,881	6,211	7,140
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	16,086	24,001	1,364	2,035
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	40,674	41,441	3,253	3,315
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,434	5,768	434	461
	その他	13,663	15,669	1,158	1,328
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	434,805	405,474	36,871	34,384
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)	286,633	261,851	24,306	22,205
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%)	1,489	1,468	119	117
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	106,507	105,773	8,520	8,461
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	106,507	105,773	8,520	8,461
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	154,209	12,336	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	154,209	154,209	12,336	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	12,074	12,071	1,018	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	3,840,599	3,835,164	323,795	323,344

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12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	3,180,098	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	125,814
3		ポートフォリオの質	△ 137,690
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	3,168,222	

(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12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 12月末	2020年 9月末	2020年 12月末	2020年 9月末
1	信用リスク	2,756,864	2,797,347	233,577	237,014
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,714,225	2,755,492	230,166	233,665
	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	42,639	41,854	3,411	3,348
4	カウンターパーティ信用リスク	75,858	86,881	6,211	7,140
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	16,086	24,001	1,364	2,035
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	40,674	41,441	3,253	3,315
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,434	5,768	434	461
	その他	13,663	15,669	1,158	1,328
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	434,765	405,434	36,868	34,380
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)	285,683	261,048	24,225	22,136
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	106,507	105,773	8,520	8,461
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	106,507	105,773	8,520	8,461
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	145,503	11,640	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	145,503	145,503	11,640	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	9,808	9,748	831	826
	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	3,814,990	3,811,736	321,875	321,601