

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:2022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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	2,707,670	2,731,282	229,224	231,212
2	うち、標準的手法適用分	35,079	34,836	2,806	2,786
3	うち、内部格付手法適用分	2,627,329	2,647,840	222,797	224,536
	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	45,261	48,605	3,620	3,888
4	カウンターパーティ信用リスク	73,550	72,997	6,048	5,995
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	16,463	17,340	1,396	1,470
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,290	36,051	2,903	2,884
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,901	4,494	232	359
	その他	17,894	15,110	1,517	1,281
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	448,854	519,617	38,062	44,063
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)	308,725	349,662	26,179	29,651
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%)	248	258	19	20
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	116,460	112,836	9,316	9,026
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	116,460	112,836	9,316	9,026
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	155,802	153,824	12,464	12,305
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,802	153,824	12,464	12,305
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	11,522	12,569	971	1,060
	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	3,822,835	3,953,050	322,289	333,337

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:2022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	3,214,288	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	30,371
3		ポートフォリオの質	△ 123,429
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	3,121,230	

(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：2022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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	2,685,492	2,708,991	227,546	229,527
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,647,344	2,668,356	224,494	226,276
	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	38,147	40,635	3,051	3,250
4	カウンターパーティ信用リスク	73,550	72,997	6,048	5,995
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	16,463	17,340	1,396	1,470
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,290	36,051	2,903	2,884
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,901	4,494	232	359
	その他	17,894	15,110	1,517	1,281
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	448,814	519,577	38,059	44,060
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)	307,713	348,615	26,094	29,562
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	116,460	112,836	9,316	9,026
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	116,460	112,836	9,316	9,026
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	146,720	144,971	11,737	11,597
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,720	144,971	11,737	11,597
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	9,363	10,323	794	875
	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	3,788,114	3,918,315	319,597	330,646