

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6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 6月末	2021年 3月末	2021年 6月末	2021年 3月末
1	信用リスク	2,738,406	2,772,751	231,822	234,741
2	うち、標準的手法適用分	34,963	33,679	2,797	2,694
3	うち、内部格付手法適用分	2,656,291	2,691,899	225,253	228,273
	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	47,151	47,171	3,772	3,773
4	カウンターパーティ信用リスク	69,685	79,664	5,710	6,514
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	16,879	17,894	1,431	1,517
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,758	45,514	2,940	3,641
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,655	4,668	372	373
	その他	11,391	11,586	966	982
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	520,489	496,253	44,137	42,082
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)	357,923	328,181	30,351	27,829
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%)	254	252	20	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	96,613	99,643	7,729	7,971
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	96,613	99,643	7,729	7,971
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	153,043	12,243	12,243
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	153,043	12,243	12,243
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	12,502	12,381	1,055	1,045
	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	3,948,919	3,942,171	333,070	332,448

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6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	3,236,208	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	128,533
3		ポートフォリオの質	△ 140,176
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	3,224,565	

(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6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 6月末	2021年 3月末	2021年 6月末	2021年 3月末
1	信用リスク	2,723,095	2,760,036	230,723	233,856
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,682,435	2,719,515	227,470	230,614
	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	40,660	40,521	3,252	3,241
4	カウンターパーティ信用リスク	69,685	79,664	5,710	6,514
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	16,879	17,894	1,431	1,517
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,758	45,514	2,940	3,641
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,655	4,668	372	373
	その他	11,391	11,586	966	982
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	520,449	496,213	44,134	42,078
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)	356,918	327,177	30,266	27,744
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	96,613	99,643	7,729	7,971
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	96,613	99,643	7,729	7,971
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	144,422	11,553	11,553
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	144,422	11,553	11,553
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	10,324	10,253	875	869
	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	3,921,510	3,917,411	330,993	330,589