

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		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9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	2,730,508	2,738,406	231,160	231,822
2	うち、標準的手法適用分	34,479	34,963	2,758	2,797
3	うち、内部格付手法適用分	2,649,935	2,656,291	224,714	225,253
	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	46,094	47,151	3,687	3,772
4	カウンターパーティ信用リスク	67,862	69,685	5,564	5,710
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	15,790	16,879	1,339	1,431
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	34,905	36,758	2,792	2,940
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,711	4,655	376	372
	その他	12,455	11,391	1,056	966
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	540,000	520,489	45,792	44,137
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)	334,836	357,923	28,394	30,351
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%)	256	254	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	110,429	96,613	8,834	7,729
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	110,429	96,613	8,834	7,729
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	153,824	153,043	12,305	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	153,824	153,043	12,305	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	12,427	12,502	1,048	1,055
	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	3,950,145	3,948,919	333,120	333,070

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	3,224,565	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	113,923
3		ポートフォリオの質	△ 101,364
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	3,237,123	

(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	
		2021年 9月末	2021年 6月末	2021年 9月末	2021年 6月末
1	信用リスク	2,709,728	2,723,095	229,595	230,723
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,670,197	2,682,435	226,432	227,470
	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	39,530	40,660	3,162	3,252
4	カウンターパーティ信用リスク	67,862	69,685	5,564	5,710
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	15,790	16,879	1,339	1,431
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	34,905	36,758	2,792	2,940
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,711	4,655	376	372
	その他	12,455	11,391	1,056	966
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	539,960	520,449	45,788	44,134
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)	333,783	356,918	28,304	30,266
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	110,429	96,613	8,834	7,729
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	110,429	96,613	8,834	7,729
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	144,971	144,422	11,597	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	144,971	144,422	11,597	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	10,272	10,324	871	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	3,917,008	3,921,510	330,556	330,993