

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	
		2021年 12月末	2021年 9月末	2021年 12月末	2021年 9月末
1	信用リスク	2,731,282	2,730,508	231,212	231,160
2	うち、標準的手法適用分	34,836	34,479	2,786	2,758
3	うち、内部格付手法適用分	2,647,840	2,649,935	224,536	224,714
	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	48,605	46,094	3,888	3,687
4	カウンターパーティ信用リスク	72,997	67,862	5,995	5,564
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	17,340	15,790	1,470	1,339
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,051	34,905	2,884	2,792
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,494	4,711	359	376
	その他	15,110	12,455	1,281	1,056
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	519,617	540,000	44,063	45,792
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)	349,662	334,836	29,651	28,394
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%)	258	256	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	112,836	110,429	9,026	8,834
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	112,836	110,429	9,026	8,834
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	153,824	12,305	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	153,824	153,824	12,305	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	12,569	12,427	1,060	1,048
	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	3,953,050	3,950,145	333,337	333,120

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	3,237,123	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	82,554
3		ポートフォリオの質	△ 105,389
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	3,214,288	

(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	
		2021年 12月末	2021年 9月末	2021年 12月末	2021年 9月末
1	信用リスク	2,708,991	2,709,728	229,527	229,595
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,668,356	2,670,197	226,276	226,432
	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	40,635	39,530	3,250	3,162
4	カウンターパーティ信用リスク	72,997	67,862	5,995	5,564
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	17,340	15,790	1,470	1,339
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,051	34,905	2,884	2,792
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,494	4,711	359	376
	その他	15,110	12,455	1,281	1,056
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	519,577	539,960	44,060	45,788
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)	348,615	333,783	29,562	28,304
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	112,836	110,429	9,026	8,834
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	112,836	110,429	9,026	8,834
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	144,971	11,597	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	144,971	144,971	11,597	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	10,323	10,272	875	871
	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	3,918,315	3,917,008	330,646	330,556