

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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	2,741,491	2,707,670	232,089	229,224
2	うち、標準的手法適用分	35,458	35,079	2,836	2,806
3	うち、内部格付手法適用分	2,660,492	2,627,329	225,609	222,797
	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	45,540	45,261	3,643	3,620
4	カウンターパーティ信用リスク	72,850	73,550	5,954	6,048
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	21,901	16,463	1,857	1,396
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	43,990	36,290	3,519	2,903
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,551	2,901	204	232
	その他	4,406	17,894	373	1,517
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	381,130	448,854	32,319	38,062
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)	299,887	308,725	25,430	26,179
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%)	244	248	19	19
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	124,964	116,460	9,997	9,316
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	124,964	116,460	9,997	9,316
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	155,802	12,464	12,464
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	155,802	12,464	12,464
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	37,719	11,522	3,193	971
	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	3,814,091	3,822,835	321,468	322,289

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	3,121,230
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		ポートフォリオの質
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	3,112,727

(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	
		2022年 6月末	2022年 3月末	2022年 6月末	2022年 3月末
1	信用リスク	2,721,863	2,685,492	230,629	227,546
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,683,470	2,647,344	227,558	224,494
	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	38,393	38,147	3,071	3,051
4	カウンターパーティ信用リスク	72,850	73,550	5,954	6,048
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	21,901	16,463	1,857	1,396
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	43,990	36,290	3,519	2,903
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,551	2,901	204	232
	その他	4,406	17,894	373	1,517
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	381,090	448,814	32,316	38,059
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)	298,938	307,713	25,349	26,094
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	124,964	116,460	9,997	9,316
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	124,964	116,460	9,997	9,316
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	146,720	11,737	11,737
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	146,720	11,737	11,737
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	31,015	9,363	2,630	794
	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	3,777,444	3,788,114	318,615	319,597