

## 自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2019年12月末・単体)

(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	
		2019年12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	5,774,179	5,410,109	488,871	458,199
2	うち、標準的手法適用分	6,440	2,994	515	239
3	うち、内部格付手法適用分	5,611,860	5,289,802	475,885	448,575
	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	155,877	117,312	12,470	9,385
4	カウンターパーティ信用リスク	406,469	487,033	33,539	39,994
5	うち、SA-CCR適用分	53,044	56,236	4,498	4,768
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	76,400	82,105	6,112	6,568
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	117,061	189,974	9,364	15,197
	その他	159,962	158,717	13,564	13,459
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	3,748,087	3,720,080	317,837	315,462
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)	21,946,193	23,112,761	1,860,718	1,959,636
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)	-	149	-	12
	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%)	258,772	231,936	21,943	19,668
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%)	900,869	988,078	72,069	79,046
11	未決済取引	122,599	549	10,396	46
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	2,158,756	2,139,222	172,700	171,137
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	2,158,756	2,139,222	172,700	171,137
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	3,286,751	3,278,770	262,940	262,301
17	うち、標準的方式適用分	3,275,135	3,267,850	262,010	261,428
18	うち、内部モデル方式適用分	11,616	10,919	929	873
19	オペレーショナル・リスク	541,046	541,046	43,283	43,283
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	541,046	541,046	43,283	43,283
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	42,638	42,638	3,615	3,615
	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	39,186,361	39,952,376	3,287,917	3,352,405