

## 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(2021年3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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	8,158,287	8,053,908	690,993	682,284
2	うち、標準的手法適用分	7,277	12,867	582	1,029
3	うち、内部格付手法適用分	7,985,535	7,910,707	677,173	670,828
	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	165,474	130,333	13,237	10,426
4	カウンターパーティ信用リスク	573,469	604,070	47,027	49,766
5	うち、SA-CCR適用分	56,728	79,437	4,810	6,736
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	63,383	81,449	5,070	6,515
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	270,444	222,469	21,635	17,797
	その他	182,912	220,713	15,510	18,716
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	3,958,461	3,679,453	335,677	312,017
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)	17,911,898	18,787,283	1,518,834	1,593,063
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%)	154,360	237,256	13,089	20,119
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%)	419,364	473,191	33,549	37,855
11	未決済取引	156,294	147,268	13,253	12,488
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	1,895,836	1,971,849	151,666	157,747
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	1,895,836	1,971,849	151,666	157,747
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	3,592,383	4,232,230	287,390	338,578
17	うち、標準的方式適用分	3,585,996	4,229,113	286,879	338,329
18	うち、内部モデル方式適用分	6,386	3,116	510	249
19	オペレーショナル・リスク	651,437	467,375	52,115	37,390
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	651,437	467,375	52,115	37,390
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	37,514,432	38,696,526	3,147,214	3,244,926