

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	
		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	7,378,184	7,426,994	624,813	628,988
2	うち、標準的手法適用分	6,410	4,884	512	390
3	うち、内部格付手法適用分	7,199,722	7,255,986	610,536	615,307
	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	172,051	166,123	13,764	13,289
4	カウンターパーティ信用リスク	575,315	583,124	47,246	47,881
5	うち、SA-CCR適用分	59,788	58,546	5,070	4,964
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	66,643	65,817	5,331	5,265
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	254,273	260,642	20,341	20,851
	その他	194,609	198,118	16,502	16,800
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	3,669,698	3,501,128	311,190	296,895
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)	18,193,036	17,651,360	1,542,720	1,496,780
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%)	200,276	159,852	16,983	13,555
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%)	531,318	581,516	42,505	46,521
11	未決済取引	161,435	157,683	13,689	13,371
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	1,428,466	1,419,194	114,277	113,535
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	1,428,466	1,419,194	114,277	113,535
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	4,265,427	3,967,798	341,234	317,423
17	うち、標準的方式適用分	4,258,377	3,962,772	340,670	317,021
18	うち、内部モデル方式適用分	7,049	5,026	563	402
19	オペレーショナル・リスク	651,437	651,437	52,115	52,115
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	651,437	52,115	52,115
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	37,097,235	36,142,729	3,110,391	3,030,684