

## 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9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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	5,410,109	5,312,609	458,199	449,853
2	うち、標準的手法適用分	2,994	3,293	239	263
3	うち、内部格付手法適用分	5,289,802	5,176,093	448,575	438,932
	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	117,312	133,222	9,385	10,657
4	カウンターパーティ信用リスク	487,033	525,924	39,994	43,091
5	うち、SA-CCR適用分	56,236	53,034	4,768	4,497
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	82,105	76,451	6,568	6,116
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	189,974	237,423	15,197	18,993
	その他	158,717	159,014	13,459	13,484
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	3,720,080	3,700,099	315,462	313,768
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)	23,112,761	22,272,557	1,959,636	1,888,528
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	581,045	12	49,272
	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%)	231,936	201,083	19,668	17,051
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%)	988,078	861,338	79,046	68,907
11	未決済取引	549	25,752	46	2,183
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	2,139,222	2,196,689	171,137	175,735
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	2,139,222	2,196,689	171,137	175,735
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	3,278,770	2,966,908	262,301	237,352
17	うち、標準的方式適用分	3,267,850	2,952,687	261,428	236,215
18	うち、内部モデル方式適用分	10,919	14,220	873	1,137
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	39,952,376	39,227,693	3,352,405	3,292,645