

## 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(2020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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	7,098,677	5,774,179	601,293	488,871
2	うち、標準的手法適用分	14,274	6,440	1,141	515
3	うち、内部格付手法適用分	6,958,141	5,611,860	590,050	475,885
	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	126,261	155,877	10,100	12,470
4	カウンターパーティ信用リスク	502,124	406,469	41,605	33,539
5	うち、SA-CCR適用分	112,547	53,044	9,544	4,498
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	111,084	76,400	8,886	6,112
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	91,998	117,061	7,359	9,364
	その他	186,494	159,962	15,814	13,564
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	3,677,083	3,748,087	311,816	317,837
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)	17,250,227	21,946,193	1,462,725	1,860,718
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%)	330,117	258,772	27,993	21,943
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%)	589,350	900,869	47,148	72,069
11	未決済取引	151,616	122,599	12,857	10,396
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	2,062,865	2,158,756	165,029	172,700
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	2,062,865	2,158,756	165,029	172,700
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	3,065,342	3,286,751	245,227	262,940
17	うち、標準的方式適用分	3,051,405	3,275,135	244,112	262,010
18	うち、内部モデル方式適用分	13,937	11,616	1,114	929
19	オペレーショナル・リスク	467,375	541,046	37,390	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	467,375	541,046	37,390	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	35,237,420	39,186,361	2,956,702	3,287,917