

## 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6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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	7,684,325	7,098,677	650,992	601,293
2	うち、標準的手法適用分	10,985	14,274	878	1,141
3	うち、内部格付手法適用分	7,551,388	6,958,141	640,357	590,050
	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	121,951	126,261	9,756	10,100
4	カウンターパーティ信用リスク	393,693	502,124	32,581	41,605
5	うち、SA-CCR適用分	63,541	112,547	5,388	9,544
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	67,134	111,084	5,370	8,886
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	100,294	91,998	8,023	7,359
	その他	162,721	186,494	13,798	15,814
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	3,793,274	3,677,083	321,669	311,816
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)	18,440,363	17,250,227	1,563,645	1,462,725
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%)	173,211	330,117	14,688	27,993
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%)	578,253	589,350	46,260	47,148
11	未決済取引	150,921	151,616	12,798	12,857
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	2,027,730	2,062,865	162,218	165,029
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	2,027,730	2,062,865	162,218	165,029
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	3,967,614	3,065,342	317,409	245,227
17	うち、標準的方式適用分	3,966,687	3,051,405	317,335	244,112
18	うち、内部モデル方式適用分	926	13,937	74	1,114
19	オペレーショナル・リスク	467,375	467,375	37,390	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	467,375	467,375	37,390	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	37,719,401	35,237,420	3,163,269	2,956,702