

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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	8,226,302	8,158,287	696,773	690,993
2	うち、標準的手法適用分	3,969	7,277	317	582
3	うち、内部格付手法適用分	8,056,100	7,985,535	683,157	677,173
	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	166,232	165,474	13,298	13,237
4	カウンターパーティ信用リスク	586,724	573,469	48,092	47,027
5	うち、SA-CCR適用分	88,286	56,728	7,486	4,810
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	93,699	63,383	7,495	5,070
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	252,586	270,444	20,206	21,635
	その他	152,152	182,912	12,902	15,510
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	3,697,047	3,958,461	313,509	335,677
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)	17,000,662	17,911,898	1,441,569	1,518,834
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%)	194,035	154,360	16,454	13,089
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%)	421,143	419,364	33,691	33,549
11	未決済取引	156,510	156,294	13,272	13,253
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	1,548,577	1,895,836	123,886	151,666
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	1,548,577	1,895,836	123,886	151,666
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	4,021,213	3,592,383	321,697	287,390
17	うち、標準的方式適用分	4,016,433	3,585,996	321,314	286,879
18	うち、内部モデル方式適用分	4,779	6,386	382	510
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	36,546,292	37,514,432	3,064,676	3,147,214