

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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	7,426,994	8,226,302	628,988	696,773
2	うち、標準的手法適用分	4,884	3,969	390	317
3	うち、内部格付手法適用分	7,255,986	8,056,100	615,307	683,157
	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	166,123	166,232	13,289	13,298
4	カウンターパーティ信用リスク	583,124	586,724	47,881	48,092
5	うち、SA-CCR適用分	58,546	88,286	4,964	7,486
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	65,817	93,699	5,265	7,495
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	260,642	252,586	20,851	20,206
	その他	198,118	152,152	16,800	12,902
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	3,501,128	3,697,047	296,895	313,509
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)	17,651,360	17,000,662	1,496,780	1,441,569
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%)	159,852	194,035	13,555	16,454
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%)	581,516	421,143	46,521	33,691
11	未決済取引	157,683	156,510	13,371	13,272
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	1,419,194	1,548,577	113,535	123,886
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	1,419,194	1,548,577	113,535	123,886
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	3,967,798	4,021,213	317,423	321,697
17	うち、標準的方式適用分	3,962,772	4,016,433	317,021	321,314
18	うち、内部モデル方式適用分	5,026	4,779	402	382
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	36,142,729	36,546,292	3,030,684	3,064,676