

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(2022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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	7,410,037	7,378,184	627,612	624,813
2	うち、標準的手法適用分	7,839	6,410	627	512
3	うち、内部格付手法適用分	7,251,884	7,199,722	614,959	610,536
	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	150,314	172,051	12,025	13,764
4	カウンターパーティ信用リスク	768,481	575,315	63,062	47,246
5	うち、SA-CCR適用分	117,866	59,788	9,995	5,070
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	119,115	66,643	9,529	5,331
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	319,444	254,273	25,555	20,341
	その他	212,055	194,609	17,982	16,502
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	3,847,395	3,669,698	326,259	311,190
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)	18,789,410	18,193,036	1,593,299	1,542,720
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%)	157,860	200,276	13,386	16,983
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%)	500,144	531,318	40,011	42,505
11	未決済取引	163,354	161,435	13,852	13,689
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	1,549,274	1,428,466	123,941	114,277
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	1,549,274	1,428,466	123,941	114,277
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	2,942,579	4,265,427	235,406	341,234
17	うち、標準的方式適用分	2,937,892	4,258,377	235,031	340,670
18	うち、内部モデル方式適用分	4,686	7,049	374	563
19	オペレーショナル・リスク	790,677	651,437	63,254	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	790,677	651,437	63,254	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	43,888	42,638	3,721	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	36,963,103	37,097,235	3,103,807	3,110,391