

## 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	
		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	7,643,997	7,410,037	647,546	627,612
2	うち、標準的手法適用分	4,658	7,839	372	627
3	うち、内部格付手法適用分	7,505,578	7,251,884	636,473	614,959
	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	133,759	150,314	10,700	12,025
4	カウンターパーティ信用リスク	618,191	768,481	50,760	63,062
5	うち、SA-CCR適用分	93,464	117,866	7,925	9,995
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	91,335	119,115	7,306	9,529
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	254,906	319,444	20,392	25,555
	その他	178,485	212,055	15,135	17,982
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	3,786,937	3,847,395	321,132	326,259
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)	19,053,428	18,789,410	1,615,677	1,593,299
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%)	163,711	157,860	13,882	13,386
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%)	608,938	500,144	48,715	40,011
11	未決済取引	173,366	163,354	14,701	13,852
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	1,718,310	1,549,274	137,464	123,941
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	1,718,310	1,549,274	137,464	123,941
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	1,889,706	2,942,579	151,176	235,406
17	うち、標準的方式適用分	1,887,304	2,937,892	150,984	235,031
18	うち、内部モデル方式適用分	2,401	4,686	192	374
19	オペレーショナル・リスク	790,677	790,677	63,254	63,254
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	790,677	63,254	63,254
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	382,910	43,888	32,470	3,721
	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	36,830,177	36,963,103	3,096,782	3,103,807