

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(2019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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	5,312,609	5,169,978	449,853	437,737
2	うち、標準的手法適用分	3,293	5,558	263	444
3	うち、内部格付手法適用分	5,176,093	5,028,963	438,932	426,456
	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	133,222	135,457	10,657	10,836
4	カウンターパーティ信用リスク	525,924	526,744	43,091	43,164
5	うち、SA-CCR適用分	53,034	54,677	4,497	4,636
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	76,451	74,451	6,116	5,956
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	237,423	238,684	18,993	19,094
	その他	159,014	158,930	13,484	13,477
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	3,700,099	1,705,918	313,768	144,661
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)	22,272,557	25,796,502	1,888,528	2,186,951
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)	581,045	1,054,709	49,272	89,439
	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%)	201,083	40,386	17,051	3,424
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%)	861,338	1,098,816	68,907	87,905
11	未決済取引	25,752	10,412	2,183	882
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	2,196,689	2,159,835	175,735	172,786
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	2,196,689	2,159,835	175,735	172,786
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	2,966,908	2,370,447	237,352	189,635
17	うち、標準的方式適用分	2,952,687	2,352,757	236,215	188,220
18	うち、内部モデル方式適用分	14,220	17,690	1,137	1,415
19	オペレーショナル・リスク	541,046	541,046	43,283	43,283
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	541,046	541,046	43,283	43,283
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	39,227,693	40,517,436	3,292,645	3,403,489