

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(2020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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	7,862,302	7,684,325	666,078	650,992
2	うち、標準的手法適用分	10,664	10,985	853	878
3	うち、内部格付手法適用分	7,727,922	7,551,388	655,327	640,357
	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	123,714	121,951	9,897	9,756
4	カウンターパーティ信用リスク	428,025	393,693	35,341	32,581
5	うち、SA-CCR適用分	66,456	63,541	5,635	5,388
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	70,354	67,134	5,628	5,370
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	128,620	100,294	10,289	8,023
	その他	162,594	162,721	13,787	13,798
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	3,668,785	3,793,274	311,113	321,669
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)	18,275,528	18,440,363	1,549,662	1,563,645
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%)	185,562	173,211	15,735	14,688
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%)	509,658	578,253	40,772	46,260
11	未決済取引	149,339	150,921	12,664	12,798
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	2,002,677	2,027,730	160,214	162,218
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	2,002,677	2,027,730	160,214	162,218
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	4,070,231	3,967,614	325,618	317,409
17	うち、標準的方式適用分	4,067,466	3,966,687	325,397	317,335
18	うち、内部モデル方式適用分	2,765	926	221	74
19	オペレーショナル・リスク	467,375	467,375	37,390	37,390
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	467,375	467,375	37,390	37,390
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	37,662,125	37,719,401	3,158,206	3,163,269