

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12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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	8,053,908	7,862,302	682,284	666,078
2	うち、標準的手法適用分	12,867	10,664	1,029	853
3	うち、内部格付手法適用分	7,910,707	7,727,922	670,828	655,327
	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	130,333	123,714	10,426	9,897
4	カウンターパーティ信用リスク	604,070	428,025	49,766	35,341
5	うち、SA-CCR適用分	79,437	66,456	6,736	5,635
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	81,449	70,354	6,515	5,628
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	222,469	128,620	17,797	10,289
	その他	220,713	162,594	18,716	13,787
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	3,679,453	3,668,785	312,017	311,113
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)	18,787,283	18,275,528	1,593,063	1,549,662
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%)	237,256	185,562	20,119	15,735
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%)	473,191	509,658	37,855	40,772
11	未決済取引	147,268	149,339	12,488	12,664
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	1,971,849	2,002,677	157,747	160,214
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	1,971,849	2,002,677	157,747	160,214
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	4,232,230	4,070,231	338,578	325,618
17	うち、標準的方式適用分	4,229,113	4,067,466	338,329	325,397
18	うち、内部モデル方式適用分	3,116	2,765	249	221
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	38,696,526	37,662,125	3,244,926	3,158,206