

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月期自己資本比率)

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (連結)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2020年9月期)	前四半期末 (2020年6月期)	当四半期末 (2020年9月期)	前四半期末 (2020年6月期)
1	信用リスク	2,369,430	2,300,700	200,693	194,844
2	うち、標準的手法適用分	6,017	7,083	481	566
3	うち、内部格付手法適用分	2,320,554	2,247,498	196,782	190,587
	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	3,713	3,743	297	299
	その他	39,144	42,375	3,131	3,390
4	カウンターパーティ信用リスク	51,900	49,709	4,341	4,165
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	4,728	4,252	400	360
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	10,367	8,293	829	663
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,096	2,146	167	171
	その他	34,707	35,017	2,943	2,969
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	227,575	221,883	19,298	18,815
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)	186,879	200,138	14,950	16,011
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%)	47,674	52,855	4,042	4,482
	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%)	36,124	52,621	3,063	4,462
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%)	428,252	364,847	34,260	29,187
11	未決済取引	—	—	—	—
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	25,402	22,919	2,032	1,833
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	25,402	22,919	2,032	1,833
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	179,676	178,712	14,374	14,296
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	179,676	178,712	14,374	14,296
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	13,622	12,663	1,155	1,073
	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	3,566,537	3,457,052	298,210	289,172

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (単体)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2020年9月期)	前四半期末 (2020年6月期)	当四半期末 (2020年9月期)	前四半期末 (2020年6月期)
1	信用リスク	2,319,764	2,255,881	196,558	191,129
2	うち、標準的手法適用分	2,277	3,524	182	281
3	うち、内部格付手法適用分	2,286,950	2,220,565	193,933	188,303
	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	30,536	31,791	2,442	2,543
4	カウンターパーティ信用リスク	51,900	49,709	4,341	4,165
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	4,728	4,252	400	360
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	10,367	8,293	829	663
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,096	2,146	167	171
	その他	34,707	35,017	2,943	2,969
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	257,120	251,474	21,803	21,325
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)	186,855	200,006	14,948	16,000
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%)	47,663	52,850	4,041	4,481
	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%)	36,090	52,493	3,060	4,451
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%)	427,384	363,325	34,190	29,066
11	未決済取引	—	—	—	—
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	25,402	22,919	2,032	1,833
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	25,402	22,919	2,032	1,833
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	151,579	150,512	12,126	12,040
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	151,579	150,512	12,126	12,040
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	12,848	11,935	1,089	1,012
	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	3,516,608	3,411,108	294,193	285,505

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。