

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  
(2021年3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 (2021年3月期)	前四半期末 (2020年12月期)	当四半期末 (2021年3月期)	前四半期末 (2020年12月期)
1	信用リスク	2,593,808	2,491,191	219,711	211,002
2	うち、標準的手法適用分	7,178	6,723	574	537
3	うち、内部格付手法適用分	2,542,989	2,438,904	215,645	206,819
	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	3,712	3,714	296	297
	その他	39,927	41,849	3,194	3,347
4	カウンターパーティ信用リスク	78,935	62,428	6,569	5,218
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	7,116	5,395	603	457
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	24,081	13,640	1,926	1,091
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,822	2,059	145	164
	その他	45,915	41,334	3,893	3,505
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	272,615	248,974	23,117	21,113
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)	174,036	191,111	13,922	15,288
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%)	37,953	48,267	3,218	4,093
	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%)	61,159	56,158	5,186	4,762
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%)	457,659	406,783	36,612	32,542
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	28,350	25,170	2,268	2,013
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	28,350	25,170	2,268	2,013
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	179,376	179,676	14,350	14,374
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	179,376	179,676	14,350	14,374
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	13,302	13,659	1,128	1,158
	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	3,897,197	3,723,422	326,084	311,566

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼン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 (2021年3月期)	前四半期末 (2020年12月期)	当四半期末 (2021年3月期)	前四半期末 (2020年12月期)
1	信用リスク	2,539,173	2,440,111	215,162	206,753
2	うち、標準的手法適用分	2,362	2,497	188	199
3	うち、内部格付手法適用分	2,505,958	2,405,132	212,505	203,955
	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	30,852	32,480	2,468	2,598
4	カウンターパーティ信用リスク	78,935	62,428	6,569	5,218
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	7,116	5,395	603	457
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	24,081	13,640	1,926	1,091
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,822	2,059	145	164
	その他	45,915	41,334	3,893	3,505
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	301,983	278,434	25,608	23,611
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)	173,993	191,079	13,919	15,286
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%)	37,892	48,254	3,213	4,091
	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%)	61,011	55,922	5,173	4,742
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%)	457,213	406,228	36,577	32,498
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	28,350	25,170	2,268	2,013
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	28,350	25,170	2,268	2,013
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	151,057	151,579	12,084	12,126
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	151,057	151,579	12,084	12,126
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	12,545	12,899	1,063	1,093
	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	3,842,157	3,672,110	321,640	307,436

(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。