

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)					
国際様式の 該当番号 (注)		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2021年9月期)	前四半期末 (2021年6月期)	当四半期末 (2021年9月期)	前四半期末 (2021年6月期)
1	信用リスク	2,621,525	2,553,311	222,064	216,261
2	うち、標準的手法適用分	6,975	7,443	558	595
3	うち、内部格付手法適用分	2,571,273	2,499,308	218,043	211,941
	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	3,695	3,717	295	297
	その他	39,580	42,842	3,166	3,427
4	カウンターパーティ信用リスク	69,212	67,369	5,772	5,616
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	6,531	6,408	553	543
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,671	18,308	1,493	1,464
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,562	1,827	124	146
	その他	42,447	40,824	3,599	3,461
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	302,370	277,525	25,641	23,534
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)	184,395	180,258	14,751	14,420
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%)	28,351	33,615	2,404	2,850
	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%)	74,863	69,849	6,348	5,923
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%)	485,742	505,107	38,859	40,408
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	29,799	27,897	2,383	2,231
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	29,799	27,897	2,383	2,231
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	180,650	179,376	14,452	14,350
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	180,650	179,376	14,452	14,350
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	12,647	12,965	1,072	1,099
	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	3,989,559	3,907,277	333,749	326,696

(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 (2021年9月期)	前四半期末 (2021年6月期)	当四半期末 (2021年9月期)	前四半期末 (2021年6月期)
1	信用リスク	2,553,403	2,500,368	216,371	211,856
2	うち、標準的手法適用分	2,355	3,141	188	251
3	うち、内部格付手法適用分	2,520,612	2,463,865	213,747	208,935
	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	30,435	33,361	2,434	2,668
4	カウンターパーティ信用リスク	69,212	67,369	5,772	5,616
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	6,531	6,408	553	543
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,671	18,308	1,493	1,464
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,562	1,827	124	146
	その他	42,447	40,824	3,599	3,461
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	331,773	306,967	28,134	26,030
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)	184,366	180,228	14,749	14,418
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%)	28,344	33,605	2,403	2,849
	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%)	74,685	69,583	6,333	5,900
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%)	485,220	504,470	38,817	40,357
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	29,799	27,897	2,383	2,231
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	29,799	27,897	2,383	2,231
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	152,332	151,057	12,186	12,084
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	152,332	151,057	12,186	12,084
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	11,905	12,220	1,009	1,036
	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	3,921,043	3,853,770	328,161	322,382

(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。