

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
(2019年12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 (2019年12月期)	前四半期末 (2019年9月期)	当四半期末 (2019年12月期)	前四半期末 (2019年9月期)
1	信用リスク	2,214,892	2,174,040	187,562	184,109
2	うち、標準的手法適用分	7,196	5,181	575	414
3	うち、内部格付手法適用分	2,160,596	2,122,049	183,218	179,949
	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	3,690	3,688	295	295
	その他	43,409	43,120	3,472	3,449
4	カウンターパーティ信用リスク	50,575	56,264	4,238	4,698
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	4,763	5,493	403	465
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	9,053	13,369	724	1,069
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,391	1,691	111	135
	その他	35,367	35,709	2,999	3,028
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	231,557	232,808	19,636	19,742
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)	219,860	205,660	17,588	16,452
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%)	54,093	58,810	4,587	4,987
	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%)	39,120	42,595	3,317	3,612
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%)	399,951	348,873	31,996	27,909
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	19,938	29,416	1,595	2,353
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	19,938	16,916	1,595	1,353
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	12,500	0	1,000
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	181,605	181,605	14,528	14,528
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	181,605	181,605	14,528	14,528
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	18,952	18,932	1,607	1,605
	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	3,430,547	3,349,007	286,657	279,999

(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。

(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 (2019年12月期)	前四半期末 (2019年9月期)	当四半期末 (2019年12月期)	前四半期末 (2019年9月期)
1	信用リスク	2,166,051	2,127,307	183,510	180,230
2	うち、標準的手法適用分	3,240	2,139	259	171
3	うち、内部格付手法適用分	2,130,529	2,092,834	180,668	177,472
	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	32,281	32,333	2,582	2,586
4	カウンターパーティ信用リスク	50,575	56,264	4,238	4,698
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	4,763	5,493	403	465
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	9,053	13,369	724	1,069
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,391	1,691	111	135
	その他	35,367	35,709	2,999	3,028
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	260,965	262,217	22,129	22,236
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)	219,763	205,586	17,581	16,446
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%)	54,089	58,793	4,586	4,985
	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%)	39,057	42,513	3,312	3,605
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%)	399,404	348,546	31,952	27,883
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	19,938	29,416	1,595	2,353
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	19,938	16,916	1,595	1,353
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	12,500	0	1,000
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	153,613	153,613	12,289	12,289
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	153,613	153,613	12,289	12,289
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	18,762	18,740	1,591	1,589
	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	3,382,222	3,302,998	282,786	276,318

(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。