

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 (2020年3月期)	前四半期末 (2019年12月期)	当四半期末 (2020年3月期)	前四半期末 (2019年12月期)
1	信用リスク	2,181,219	2,214,892	184,711	187,562
2	うち、標準的手法適用分	7,249	7,196	579	575
3	うち、内部格付手法適用分	2,127,905	2,160,596	180,446	183,218
	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	3,732	3,690	298	295
	その他	42,332	43,409	3,386	3,472
4	カウンターパーティ信用リスク	52,656	50,575	4,410	4,238
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	5,106	4,763	433	403
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	9,465	9,053	757	724
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,952	1,391	156	111
	その他	36,131	35,367	3,063	2,999
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	289,821	231,557	24,576	19,636
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)	219,403	219,860	17,552	17,588
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%)	51,223	54,093	4,343	4,587
	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%)	38,874	39,120	3,296	3,317
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%)	406,258	399,951	32,500	31,996
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	22,589	19,938	1,807	1,595
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	22,586	19,938	1,806	1,595
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	2	0	0	0
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	178,712	181,605	14,296	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	178,712	181,605	14,296	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	12,684	18,952	1,075	1,607
	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	3,453,442	3,430,547	288,571	286,657

(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)

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 (2020年3月期)	前四半期末 (2019年12月期)	当四半期末 (2020年3月期)	前四半期末 (2019年12月期)
1	信用リスク	2,135,478	2,166,051	180,918	183,510
2	うち、標準的手法適用分	3,445	3,240	275	259
3	うち、内部格付手法適用分	2,100,000	2,130,529	178,080	180,668
	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	32,032	32,281	2,562	2,582
4	カウンターパーティ信用リスク	52,656	50,575	4,410	4,238
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	5,106	4,763	433	403
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	9,465	9,053	757	724
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,952	1,391	156	111
	その他	36,131	35,367	3,063	2,999
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	319,242	260,965	27,071	22,129
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)	219,286	219,763	17,542	17,581
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%)	51,212	54,089	4,342	4,586
	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%)	38,740	39,057	3,285	3,312
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%)	404,929	399,404	32,394	31,952
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	22,589	19,938	1,807	1,595
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	22,586	19,938	1,806	1,595
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	2	0	0	0
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	150,512	153,613	12,040	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	150,512	153,613	12,040	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	12,509	18,762	1,060	1,591
	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	3,407,156	3,382,222	284,874	282,786

(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。