

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 (2020年12月期)	前四半期末 (2020年9月期)	当四半期末 (2020年12月期)	前四半期末 (2020年9月期)
1	信用リスク	2,491,191	2,369,430	211,002	200,693
2	うち、標準的手法適用分	6,723	6,017	537	481
3	うち、内部格付手法適用分	2,438,904	2,320,554	206,819	196,782
	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	3,714	3,713	297	297
	その他	41,849	39,144	3,347	3,131
4	カウンターパーティ信用リスク	62,428	51,900	5,218	4,341
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	5,395	4,728	457	400
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,640	10,367	1,091	829
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,059	2,096	164	167
	その他	41,334	34,707	3,505	2,943
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	248,974	227,575	21,113	19,298
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)	191,111	186,879	15,288	14,950
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%)	48,267	47,674	4,093	4,042
	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%)	56,158	36,124	4,762	3,063
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%)	406,783	428,252	32,542	34,260
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	25,170	25,402	2,013	2,032
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	25,170	25,402	2,013	2,032
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	179,676	14,374	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	179,676	179,676	14,374	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	13,659	13,622	1,158	1,155
	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	3,723,422	3,566,537	311,566	298,210

(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 (2020年12月期)	前四半期末 (2020年9月期)	当四半期末 (2020年12月期)	前四半期末 (2020年9月期)
1	信用リスク	2,440,111	2,319,764	206,753	196,558
2	うち、標準的手法適用分	2,497	2,277	199	182
3	うち、内部格付手法適用分	2,405,132	2,286,950	203,955	193,933
	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	32,480	30,536	2,598	2,442
4	カウンターパーティ信用リスク	62,428	51,900	5,218	4,341
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	5,395	4,728	457	400
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,640	10,367	1,091	829
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,059	2,096	164	167
	その他	41,334	34,707	3,505	2,943
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	278,434	257,120	23,611	21,803
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)	191,079	186,855	15,286	14,948
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%)	48,254	47,663	4,091	4,041
	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%)	55,922	36,090	4,742	3,060
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%)	406,228	427,384	32,498	34,190
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	25,170	25,402	2,013	2,032
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	25,170	25,402	2,013	2,032
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	151,579	12,126	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	151,579	151,579	12,126	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	12,899	12,848	1,093	1,089
	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	3,672,110	3,516,608	307,436	294,193

(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。