

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6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6月期)	前四半期末 (2021年3月期)	当四半期末 (2021年6月期)	前四半期末 (2021年3月期)
1	信用リスク	2,553,311	2,593,808	216,261	219,711
2	うち、標準的手法適用分	7,443	7,178	595	574
3	うち、内部格付手法適用分	2,499,308	2,542,989	211,941	215,645
	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	3,717	3,712	297	296
	その他	42,842	39,927	3,427	3,194
4	カウンターパーティ信用リスク	67,369	78,935	5,616	6,569
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	6,408	7,116	543	603
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,308	24,081	1,464	1,926
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,827	1,822	146	145
	その他	40,824	45,915	3,461	3,893
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	277,525	272,615	23,534	23,117
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)	180,258	174,036	14,420	13,922
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%)	33,615	37,953	2,850	3,218
	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%)	69,849	61,159	5,923	5,186
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%)	505,107	457,659	40,408	36,612
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	27,897	28,350	2,231	2,268
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	27,897	28,350	2,231	2,268
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	179,376	14,350	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	179,376	179,376	14,350	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	12,965	13,302	1,099	1,128
	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	3,907,277	3,897,197	326,696	326,084

(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6月期)	前四半期末 (2021年3月期)	当四半期末 (2021年6月期)	前四半期末 (2021年3月期)
1	信用リスク	2,500,368	2,539,173	211,856	215,162
2	うち、標準的手法適用分	3,141	2,362	251	188
3	うち、内部格付手法適用分	2,463,865	2,505,958	208,935	212,505
	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	33,361	30,852	2,668	2,468
4	カウンターパーティ信用リスク	67,369	78,935	5,616	6,569
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	6,408	7,116	543	603
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,308	24,081	1,464	1,926
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,827	1,822	146	145
	その他	40,824	45,915	3,461	3,893
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	306,967	301,983	26,030	25,608
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)	180,228	173,993	14,418	13,919
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%)	33,605	37,892	2,849	3,213
	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%)	69,583	61,011	5,900	5,173
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%)	504,470	457,213	40,357	36,577
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	27,897	28,350	2,231	2,268
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	27,897	28,350	2,231	2,268
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	151,057	12,084	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	151,057	151,057	12,084	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	12,220	12,545	1,036	1,063
	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	3,853,770	3,842,157	322,382	321,640

(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。