

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)					
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12月期)	前四半期末 (2021年9月期)	当四半期末 (2021年12月期)	前四半期末 (2021年9月期)
1	信用リスク	2,612,534	2,621,525	221,294	222,064
2	うち、標準的手法適用分	7,099	6,975	567	558
3	うち、内部格付手法適用分	2,560,772	2,571,273	217,153	218,043
	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	3,658	3,695	292	295
	その他	41,003	39,580	3,280	3,166
4	カウンターパーティ信用リスク	66,720	69,212	5,564	5,772
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	6,513	6,531	552	553
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,989	18,671	1,439	1,493
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,519	1,562	121	124
	その他	40,697	42,447	3,451	3,599
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	295,944	302,370	25,096	25,641
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)	185,607	184,395	14,848	14,751
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%)	28,349	28,351	2,404	2,404
	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%)	74,573	74,863	6,323	6,348
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%)	620,139	485,742	49,611	38,859
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	30,200	29,799	2,416	2,383
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	30,200	29,799	2,416	2,383
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	180,650	14,452	14,452
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	180,650	14,452	14,452
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	12,698	12,647	1,076	1,072
	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	4,107,418	3,989,559	343,087	333,749

(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12月期)	前四半期末 (2021年9月期)	当四半期末 (2021年12月期)	前四半期末 (2021年9月期)
1	信用リスク	2,546,713	2,553,403	215,798	216,371
2	うち、標準的手法適用分	3,100	2,355	248	188
3	うち、内部格付手法適用分	2,512,767	2,520,612	213,082	213,747
	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	30,845	30,435	2,467	2,434
4	カウンターパーティ信用リスク	66,720	69,212	5,564	5,772
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	6,513	6,531	552	553
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,989	18,671	1,439	1,493
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,519	1,562	121	124
	その他	40,697	42,447	3,451	3,599
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	326,280	331,773	27,668	28,134
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)	185,565	184,366	14,845	14,749
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%)	28,342	28,344	2,403	2,403
	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%)	74,388	74,685	6,308	6,333
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%)	619,489	485,220	49,559	38,817
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	30,200	29,799	2,416	2,383
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	30,200	29,799	2,416	2,383
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	152,332	12,186	12,186
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	152,332	12,186	12,186
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	11,954	11,905	1,013	1,009
	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	4,041,988	3,921,043	337,763	328,161

(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。