

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
(2022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)					
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 (2022年3月期)	前四半期末 (2021年12月期)	当四半期末 (2022年3月期)	前四半期末 (2021年12月期)
1	信用リスク	2,596,696	2,612,534	219,962	221,294
2	うち、標準的手法適用分	7,203	7,099	576	567
3	うち、内部格付手法適用分	2,547,237	2,560,772	216,005	217,153
	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	3,651	3,658	292	292
	その他	38,604	41,003	3,088	3,280
4	カウンターパーティ信用リスク	74,919	66,720	6,202	5,564
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	9,286	6,513	787	552
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,376	17,989	2,430	1,439
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	934	1,519	74	121
	その他	34,321	40,697	2,910	3,451
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	266,591	295,944	22,606	25,096
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)	213,441	185,607	17,075	14,848
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%)	27,403	28,349	2,323	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%)	59,764	74,573	5,068	6,323
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%)	676,835	620,139	54,146	49,611
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	31,624	30,200	2,529	2,416
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	31,624	30,200	2,529	2,416
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	180,660	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	180,660	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	560	12,698	47	1,076
	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	4,128,496	4,107,418	344,416	343,087

(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 (2022年3月期)	前四半期末 (2021年12月期)	当四半期末 (2022年3月期)	前四半期末 (2021年12月期)
1	信用リスク	2,529,385	2,546,713	214,334	215,798
2	うち、標準的手法適用分	3,345	3,100	267	248
3	うち、内部格付手法適用分	2,496,563	2,512,767	211,708	213,082
	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	29,476	30,845	2,358	2,467
4	カウンターパーティ信用リスク	74,919	66,720	6,202	5,564
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	9,286	6,513	787	552
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,376	17,989	2,430	1,439
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	934	1,519	74	121
	その他	34,321	40,697	2,910	3,451
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	296,980	326,280	25,183	27,668
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)	213,217	185,565	17,057	14,845
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%)	27,396	28,342	2,323	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%)	59,557	74,388	5,050	6,308
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%)	676,154	619,489	54,092	49,559
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	31,624	30,200	2,529	2,416
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	31,624	30,200	2,529	2,416
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	152,168	152,332	12,173	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	152,168	152,332	12,173	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	—	1,013
	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	4,061,403	4,041,988	338,947	337,763

(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。