

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 (2022年6月期)	前四半期末 (2022年3月期)	当四半期末 (2022年6月期)	前四半期末 (2022年3月期)
1	信用リスク	2,580,835	2,596,696	218,586	219,962
2	うち、標準的手法適用分	8,888	7,203	711	576
3	うち、内部格付手法適用分	2,524,974	2,547,237	214,117	216,005
	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	3,642	3,651	291	292
	その他	43,330	38,604	3,466	3,088
4	カウンターパーティ信用リスク	95,436	74,919	7,858	6,202
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	13,665	9,286	1,158	787
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	47,725	30,376	3,818	2,430
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,054	934	84	74
	その他	32,991	34,321	2,797	2,910
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	304,986	266,591	25,862	22,606
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)	205,569	213,441	16,445	17,075
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%)	31,974	27,403	2,711	2,323
	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%)	58,922	59,764	4,996	5,068
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%)	771,097	676,835	61,687	54,146
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	30,426	31,624	2,434	2,529
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	30,426	31,624	2,434	2,529
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	180,660	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	180,660	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	560	47	47
	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	4,260,468	4,128,496	355,084	344,416

(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6月期)	前四半期末 (2022年3月期)	当四半期末 (2022年6月期)	前四半期末 (2022年3月期)
1	信用リスク	2,514,208	2,529,385	213,016	214,334
2	うち、標準的手法適用分	5,400	3,345	432	267
3	うち、内部格付手法適用分	2,474,996	2,496,563	209,879	211,708
	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	33,811	29,476	2,704	2,358
4	カウンターパーティ信用リスク	95,436	74,919	7,858	6,202
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	13,665	9,286	1,158	787
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	47,725	30,376	3,818	2,430
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,054	934	84	74
	その他	32,991	34,321	2,797	2,910
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	320,508	296,980	27,179	25,183
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)	233,420	213,217	18,673	17,057
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%)	31,936	27,396	2,708	2,323
	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%)	58,748	59,557	4,981	5,050
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%)	768,401	676,154	61,472	54,092
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	30,426	31,624	2,434	2,529
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	30,426	31,624	2,434	2,529
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	152,168	12,173	12,173
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	152,168	12,173	12,173
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	—	—	—	—
	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	4,205,256	4,061,403	350,498	338,947

(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。