

## 連結自己資本規制および連結流動性規制に関する開示の訂正について

過去に公表いたしました連結自己資本規制および連結流動性規制に関する開示に誤りがありました。主にマーケット・リスクと、レポ取引に関する信用リスクが過少に計上されておりました。お詫び申し上げますとともに、下記の通り訂正いたします。

### 【2020年12月末】

#### 第1章 自己資本の構成に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年9月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	40,441	<u>42,578</u>	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	154,219	<u>190,268</u>	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	2,636,197	<u>2,537,975</u>	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	2,952,884	<u>2,855,593</u>	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	2,961,181	<u>2,886,649</u>	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>14,861,662</u>	<u>14,822,408</u>	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>17.73%</u>	<u>17.12%</u>	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>19.86%</u>	<u>19.26%</u>	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>19.92%</u>	<u>19.47%</u>	
68	連結資本バッファ比率	<u>11.92%</u>	<u>11.47%</u>	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年12月末	2020年9月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	40,441	<u>42,841</u>	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	154,219	<u>190,532</u>	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	2,636,197	<u>2,537,712</u>	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	2,952,884	<u>2,855,329</u>	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	2,961,181	<u>2,886,385</u>	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>14,974,069</u>	<u>15,037,167</u>	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>17.60%</u>	<u>16.87%</u>	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>19.71%</u>	<u>18.98%</u>	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>19.77%</u>	<u>19.19%</u>	
68	連結資本バッファ比率	<u>11.77%</u>	<u>11.19%</u>	

### 第3章 定量的な開示事項

#### (1) 主要な指標

##### KM1：主要な指標

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年12月末	2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,636,197	<u>2,537,975</u>	<u>2,546,285</u>	2,404,634	2,534,259
2	Tier1資本の額	2,952,884	<u>2,855,593</u>	<u>2,864,191</u>	2,571,500	2,701,086
3	総自己資本の額	2,961,181	<u>2,886,649</u>	<u>2,895,315</u>	2,602,379	2,747,178
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>14,861,662</u>	<u>14,822,408</u>	<u>16,077,794</u>	15,674,493	14,028,085
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>17.73%</u>	<u>17.12%</u>	<u>15.83%</u>	15.34%	18.06%
6	連結Tier1比率	<u>19.86%</u>	<u>19.26%</u>	<u>17.81%</u>	16.40%	19.25%
7	連結総自己資本比率	<u>19.92%</u>	<u>19.47%</u>	<u>18.00%</u>	16.60%	19.58%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>11.92%</u>	<u>11.47%</u>	<u>10.00%</u>	8.60%	11.58%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	52,562,587	<u>48,731,347</u>	<u>48,053,266</u>	53,135,763	55,692,934

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年12月末	2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	2,636,197	<u>2,537,712</u>	<u>2,546,444</u>	2,404,634	2,534,259
2	Tier1資本の額	2,952,884	<u>2,855,329</u>	<u>2,864,351</u>	2,571,500	2,701,086
3	総自己資本の額	2,961,181	<u>2,886,385</u>	<u>2,895,475</u>	2,602,379	2,747,178
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>14,974,069</u>	<u>15,037,167</u>	<u>16,092,669</u>	15,674,493	14,028,085
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>17.60%</u>	<u>16.87%</u>	<u>15.82%</u>	15.34%	18.06%
6	連結Tier1比率	<u>19.71%</u>	<u>18.98%</u>	<u>17.79%</u>	16.40%	19.25%
7	連結総自己資本比率	<u>19.77%</u>	<u>19.19%</u>	<u>17.99%</u>	16.60%	19.58%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>11.77%</u>	<u>11.19%</u>	<u>9.99%</u>	8.60%	11.58%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	52,562,587	<u>48,731,083</u>	<u>48,053,426</u>	53,135,763	55,692,934

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

<訂正前>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
4	カウンターパーティ信用リスク	3,654,272	<u>3,528,002</u>	301,717	<u>290,922</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,182,214	<u>1,142,030</u>	100,251	<u>96,844</u>
	うち、CVAリスク	1,273,156	<u>1,368,345</u>	101,852	<u>109,467</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	405,651	<u>337,085</u>	32,452	<u>26,966</u>
	その他	211,455	<u>144,891</u>	17,930	<u>12,285</u>
16	マーケット・リスク	<u>4,224,567</u>	<u>4,270,586</u>	<u>337,965</u>	<u>341,646</u>
18	うち、内部モデル方式適用分	<u>3,553,787</u>	<u>3,570,241</u>	<u>284,303</u>	<u>285,619</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>14,861,662</u>	<u>14,822,408</u>	<u>1,188,933</u>	<u>1,185,792</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
4	カウンターパーティ信用リスク	3,654,272	<u>3,559,438</u>	301,717	<u>293,532</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	1,182,214	<u>1,161,606</u>	100,251	<u>98,504</u>
	うち、CVAリスク	1,273,156	<u>1,377,588</u>	101,852	<u>110,207</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	405,651	<u>339,502</u>	32,452	<u>27,160</u>
	その他	211,455	<u>145,091</u>	17,930	<u>12,302</u>
16	マーケット・リスク	<u>4,336,974</u>	<u>4,452,722</u>	<u>346,957</u>	<u>356,217</u>
18	うち、内部モデル方式適用分	<u>3,666,194</u>	<u>3,752,378</u>	<u>293,295</u>	<u>300,190</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>14,974,069</u>	<u>15,037,167</u>	<u>1,197,925</u>	<u>1,202,973</u>

(3) リスク・アセットの変動表

**CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセットの変動表**

<訂正前>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,142,030</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>35,655</u>
3		取引相手方の信用力	<u>12,457</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,161,606</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>15,928</u>
3		取引相手方の信用力	<u>12,608</u>

## MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

<訂正前>

(単位：百万円)

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・アット・リスク	ストレステスト・バリュエーション・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	<u>1,269,706</u>	<u>819,766</u>	1,359,105	121,664		<u>3,570,241</u>	
1b	前四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	<u>0.81</u>	<u>0.86</u>	1.06	1.00		0.92	
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	<u>1,556,152</u>	<u>945,530</u>	1,270,755	121,664		<u>3,894,102</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	<u>12,784</u>	<u>△96,784</u>	363,554	<u>△16,776</u>		<u>262,778</u>
3		モデルの更新又は変更	<u>△296,210</u>	<u>△3,792</u>	—	—		<u>△300,003</u>
6		為替の変動	<u>△29,711</u>	<u>△19,725</u>	<u>△38,152</u>	<u>△2,448</u>		<u>△90,038</u>
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	<u>1,243,014</u>	<u>825,228</u>	1,596,157	102,439		<u>3,766,839</u>	
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	<u>0.77</u>	<u>1.07</u>	1.00	1.00		<u>0.95</u>	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	<u>964,033</u>	<u>891,157</u>	1,596,157	102,439		<u>3,553,787</u>	

<訂正後>

(単位：百万円)

MR 2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因								
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	
		バリュエーション・アット・リスク	ストレステスト・バリュエーション・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計	
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	<u>1,433,585</u>	<u>838,023</u>	1,359,105	121,664		<u>3,752,378</u>	
1b	前四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	<u>0.82</u>	<u>0.85</u>	1.06	1.00		0.92	
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	<u>1,728,117</u>	<u>975,309</u>	1,270,755	121,664		<u>4,095,846</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	<u>△260,014</u>	<u>△146,597</u>	363,554	<u>△16,776</u>		<u>△59,833</u>
3		モデルの更新又は変更	<u>18,232</u>	<u>38,524</u>	—	—		<u>56,757</u>
6		為替の変動	<u>△34,698</u>	<u>△20,245</u>	<u>△38,152</u>	<u>△2,448</u>		<u>△95,545</u>
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	<u>1,451,637</u>	<u>846,990</u>	1,596,157	102,439		<u>3,997,224</u>	
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整	<u>0.74</u>	<u>1.04</u>	1.00	1.00		<u>0.92</u>	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	<u>1,086,312</u>	<u>881,285</u>	1,596,157	102,439		<u>3,666,194</u>	

## 第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年12月末	2020年9月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	164,669	<u>169,715</u>
3		オン・バランス資産の額 (イ)	23,801,360	<u>22,766,530</u>
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	2,952,884	<u>2,855,593</u>
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	52,562,587	<u>48,731,347</u>
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	52,562,587	<u>48,731,347</u>
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	54,477,616	<u>51,383,294</u>

<訂正後>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年12月末	2020年9月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	164,669	<u>169,979</u>
3		オン・バランス資産の額 (イ)	23,801,360	<u>22,766,266</u>
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	2,952,884	<u>2,855,329</u>
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	52,562,587	<u>48,731,083</u>
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	52,562,587	<u>48,731,083</u>
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	54,477,616	<u>51,383,030</u>



## 【2020年9月末】

### 第1章 自己資本の構成に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2020年9月末	2020年6月末	別紙様式第八号(CC2)の参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	<u>42,578</u>	<u>37,745</u>	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	<u>190,268</u>	<u>229,693</u>	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	<u>2,537,975</u>	<u>2,546,285</u>	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	<u>2,855,593</u>	<u>2,864,191</u>	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	<u>2,886,649</u>	<u>2,895,315</u>	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>14,822,408</u>	<u>16,077,794</u>	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>17.12%</u>	<u>15.83%</u>	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>19.26%</u>	<u>17.81%</u>	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>19.47%</u>	<u>18.00%</u>	
68	連結資本バッファ比率	<u>11.47%</u>	<u>10.00%</u>	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年9月末	2020年6月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	42,841	37,585	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	190,532	229,533	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	2,537,712	2,546,444	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	2,855,329	2,864,351	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	2,886,385	2,895,475	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	15,037,167	16,092,669	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	16.87%	15.82%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	18.98%	17.79%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	19.19%	17.99%	
68	連結資本バッファ比率	11.19%	9.99%	

### 第3章 定量的な開示事項

#### (1) 主要な指標

##### KM1：主要な指標

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末	2019年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,537,975</u>	<u>2,546,285</u>	2,404,634	2,534,259	2,524,353
2	Tier1資本の額	<u>2,855,593</u>	<u>2,864,191</u>	2,571,500	2,701,086	2,691,284
3	総自己資本の額	<u>2,886,649</u>	<u>2,895,315</u>	2,602,379	2,747,178	2,737,400
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>14,822,408</u>	<u>16,077,794</u>	15,674,493	14,028,085	14,576,989
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>17.12%</u>	<u>15.83%</u>	15.34%	18.06%	17.31%
6	連結Tier1比率	<u>19.26%</u>	<u>17.81%</u>	16.40%	19.25%	18.46%
7	連結総自己資本比率	<u>19.47%</u>	<u>18.00%</u>	16.60%	19.58%	18.77%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>11.47%</u>	<u>10.00%</u>	8.60%	11.58%	10.77%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>48,731,347</u>	<u>48,053,266</u>	53,135,763	55,692,934	54,906,506

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末	2019年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,537,712</u>	<u>2,546,444</u>	2,404,634	2,534,259	2,524,353
2	Tier1資本の額	<u>2,855,329</u>	<u>2,864,351</u>	2,571,500	2,701,086	2,691,284
3	総自己資本の額	<u>2,886,385</u>	<u>2,895,475</u>	2,602,379	2,747,178	2,737,400
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>15,037,167</u>	<u>16,092,669</u>	15,674,493	14,028,085	14,576,989
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>16.87%</u>	<u>15.82%</u>	15.34%	18.06%	17.31%
6	連結Tier1比率	<u>18.98%</u>	<u>17.79%</u>	16.40%	19.25%	18.46%
7	連結総自己資本比率	<u>19.19%</u>	<u>17.99%</u>	16.60%	19.58%	18.77%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>11.19%</u>	<u>9.99%</u>	8.60%	11.58%	10.77%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>48,731,083</u>	<u>48,053,426</u>	53,135,763	55,692,934	54,906,506

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

<訂正前>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,528,002</u>	<u>3,691,172</u>	<u>290,922</u>	<u>304,101</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,142,030</u>	<u>1,172,079</u>	<u>96,844</u>	<u>99,392</u>
	うち、CVAリスク	<u>1,368,345</u>	<u>1,498,422</u>	<u>109,467</u>	<u>119,873</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>337,085</u>	<u>342,389</u>	<u>26,966</u>	<u>27,391</u>
	その他	<u>144,891</u>	<u>181,879</u>	<u>12,285</u>	<u>15,419</u>
16	マーケット・リスク	<u>4,270,586</u>	<u>5,586,351</u>	<u>341,646</u>	<u>446,908</u>
18	うち、内部モデル方式適用分	<u>3,570,241</u>	<u>4,993,500</u>	<u>285,619</u>	<u>399,480</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>14,822,408</u>	<u>16,077,794</u>	<u>1,185,792</u>	<u>1,286,223</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,559,438</u>	<u>3,705,362</u>	<u>293,532</u>	<u>305,291</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,161,606</u>	<u>1,183,492</u>	<u>98,504</u>	<u>100,360</u>
	うち、CVAリスク	<u>1,377,588</u>	<u>1,498,422</u>	<u>110,207</u>	<u>119,873</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>339,502</u>	<u>345,165</u>	<u>27,160</u>	<u>27,613</u>
	その他	<u>145,091</u>	<u>181,879</u>	<u>12,302</u>	<u>15,419</u>
16	マーケット・リスク	<u>4,452,722</u>	<u>5,586,351</u>	<u>356,217</u>	<u>446,908</u>
18	うち、内部モデル方式適用分	<u>3,752,378</u>	<u>4,993,500</u>	<u>300,190</u>	<u>399,480</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>15,037,167</u>	<u>16,092,669</u>	<u>1,202,973</u>	<u>1,287,413</u>

(4) カウンターパーティー信用リスクに関する事項

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャーの額

<訂正前>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
2	期待エクスポージャー方式			3,310,986	1.4	4,642,106	1,142,030
4	信用リスク削減手法における包括的手法					1,928,236	144,891
6	合計						1,822,571

<訂正後>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される $\alpha$	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
2	期待エクスポージャー方式			3,413,184	1.4	4,785,184	1,161,606
4	信用リスク削減手法における包括的手法					1,932,263	145,091
6	合計						1,842,347

## CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課

<訂正前>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	2,993,820	1,074,914
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		632,802
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,865,815	1,368,345

<訂正後>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	2,993,820	1,084,157
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		642,044
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,865,815	1,377,588

## CCR 4 : 内部格付手法 - ポートフォリオ別及びPD 区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

<訂正前>

2020年9月末

(単位: 百万円、%、千件、年)

CCR 4 : 内部格付手法 - ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方の 数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,135,554	0.02%	0.1	44.24%	0.5	34,738	3.05%
3	0.25以上0.50未満	27,927	0.29%	100件未満	45.00%	0.8	10,281	36.81%
4	0.50以上0.75未満	3,581	0.61%	100件未満	45.00%	0.0	1,831	51.12%
7	10.00以上100.00未満	734	27.71%	100件未満	45.00%	0.0	1,663	226.49%
9	小計	1,215,217	0.10%	0.1	44.29%	0.5	89,276	7.34%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,242,605	0.05%	0.3	35.78%	0.9	285,857	12.74%
3	0.25以上0.50未満	153,653	0.35%	0.1	17.30%	1.8	27,147	17.66%
5	0.75以上2.50未満	102,507	1.67%	100件未満	10.73%	1.1	19,198	18.72%
9	小計	3,012,665	0.48%	0.8	31.39%	1.1	485,596	16.11%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,944,357	0.06%	5.3	40.31%	1.2	293,272	15.08%
2	0.15以上0.25未満	213,756	0.19%	0.5	44.99%	1.0	75,475	35.30%
3	0.25以上0.50未満	310,180	0.33%	0.4	42.41%	1.0	147,037	47.40%
7	10.00以上100.00未満	147,753	27.71%	1.8	27.86%	0.8	238,441	161.37%
9	小計	3,167,681	2.32%	9.1	39.41%	1.1	1,233,891	38.95%
合計 (全てのポートフォリオ)		7,395,564	1.21%	10.2	36.95%	1.0	1,808,764	24.45%



<訂正後>

2020年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

CCR 4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方の 数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,082,538	0.02%	0.1	44.21%	0.5	34,619	3.19%
3	0.25以上0.50未満	27,931	0.29%	100件未満	45.00%	0.8	10,282	36.81%
4	0.50以上0.75未満	3,505	0.61%	100件未満	45.00%	0.0	1,795	51.22%
7	10.00以上100.00未満	1,513	27.71%	100件未満	45.00%	0.0	3,428	226.49%
9	小計	1,162,907	0.13%	0.1	44.26%	0.5	90,888	7.81%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,281,784	0.05%	0.3	35.94%	0.9	289,657	12.69%
3	0.25以上0.50未満	153,685	0.35%	0.1	17.31%	1.8	27,159	17.67%
5	0.75以上2.50未満	102,506	1.67%	100件未満	10.73%	1.1	19,197	18.72%
9	小計	3,051,876	0.47%	0.8	31.56%	1.0	489,407	16.03%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	2,103,443	0.06%	5.3	40.66%	1.2	304,944	14.49%
2	0.15以上0.25未満	213,704	0.19%	0.5	44.99%	1.0	75,460	35.31%
3	0.25以上0.50未満	310,309	0.33%	0.4	42.41%	1.0	147,087	47.40%
7	10.00以上100.00未満	148,795	27.71%	1.8	27.98%	0.8	241,086	162.02%
9	小計	3,327,885	2.22%	9.2	39.68%	1.1	1,248,245	37.50%
合計 (全てのポートフォリオ)		7,542,669	1.19%	10.2	37.10%	1.0	1,828,541	24.24%

**CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセットの変動表**

<訂正前>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点（2020年6月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,172,079</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>39,445</u>
3		取引相手方の信用力	<u>△50,785</u>
7		為替の変動	<u>△18,710</u>
9	当四半期末時点（2020年9月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,142,030</u>	

<訂正後>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点（2020年6月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,183,492</u>	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>48,514</u>
3		取引相手方の信用力	<u>△51,402</u>
7		為替の変動	<u>△18,998</u>
9	当四半期末時点（2020年9月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,161,606</u>	

## CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー

<訂正前>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		<u>184,488</u>
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	<u>5,964,052</u>	<u>119,281</u>
5	（iii）レポ形式の取引	<u>340,917</u>	<u>6,818</u>
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		<u>152,596</u>
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	<u>91,472</u>	<u>83,296</u>
15	（iii）レポ形式の取引	<u>10,386</u>	<u>2,211</u>

<訂正後>

2020年9月末

(単位：百万円)

CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー（信用リスク削減手法適用後）	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		<u>184,512</u>
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	<u>5,965,228</u>	<u>119,304</u>
5	（iii）レポ形式の取引	<u>342,093</u>	<u>6,841</u>
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー（合計）		<u>154,990</u>
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー（当初証拠金を除く。）	<u>103,440</u>	<u>85,690</u>
15	（iii）レポ形式の取引	<u>22,355</u>	<u>4,604</u>

(6) マーケット・リスクに関する事項

MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

<訂正前>

(単位：百万円)

MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番			バリュー・ア ット・リスク	ストレ ス・バ リュー・ア ット・リ スク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
2	当四半期中	リスク量の変動	250,515	168,863	△338,073	14,933		96,239
3	の要因別の	モデルの更新又は変更	13,956	30,230	—	—		44,186
6	変動額	為替の変動	△31,096	△18,894	△25,393	△2,431		△77,815
8a	当四半期末(2020年9月末)の算出基準日における内部モデル方式の算出額		1,556,152	945,530	1,270,755	121,664		3,894,102
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整		0.81	0.86	1.06	1.00		0.92
8c	当四半期末におけるリスク・アセット		1,269,706	819,766	1,359,105	121,664		3,570,241

<訂正後>

(単位：百万円)

MR2：内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因			イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
項番			バリュー・ア ット・リスク	ストレ ス・バ リュー・ア ット・リ スク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
2	当四半期中	リスク量の変動	1,344,791	361,725	△338,073	14,933		1,383,377
3	の要因別の	モデルの更新又は変更	△904,918	△132,258	—	—		△1,037,176
6	変動額	為替の変動	△34,532	△19,489	△25,393	△2,431		△81,847
8a	当四半期末(2020年9月末)の算出基準日における内部モデル方式の算出額		1,728,117	975,309	1,270,755	121,664		4,095,846
8b	当四半期末における連結自己資本規則上のリスク・アセット額への調整		0.82	0.85	1.06	1.00		0.92
8c	当四半期末におけるリスク・アセット		1,433,585	838,023	1,359,105	121,664		3,752,378

### MR3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

<訂正前>

（単位：百万円）

MR3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）			
項番		2020年9月末	2019年9月末
バリュアットリスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）			
2	平均値	43,738	21,454
4	期末	41,497	22,345
ストレス・バリュアットリスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）			
6	平均値	29,162	36,359
7	最小値	16,823	22,740
8	期末	25,214	44,736
包括的リスクの額（片側信頼区間99.9%）			
17	フロア（修正標準的方式）	7,407	5,272

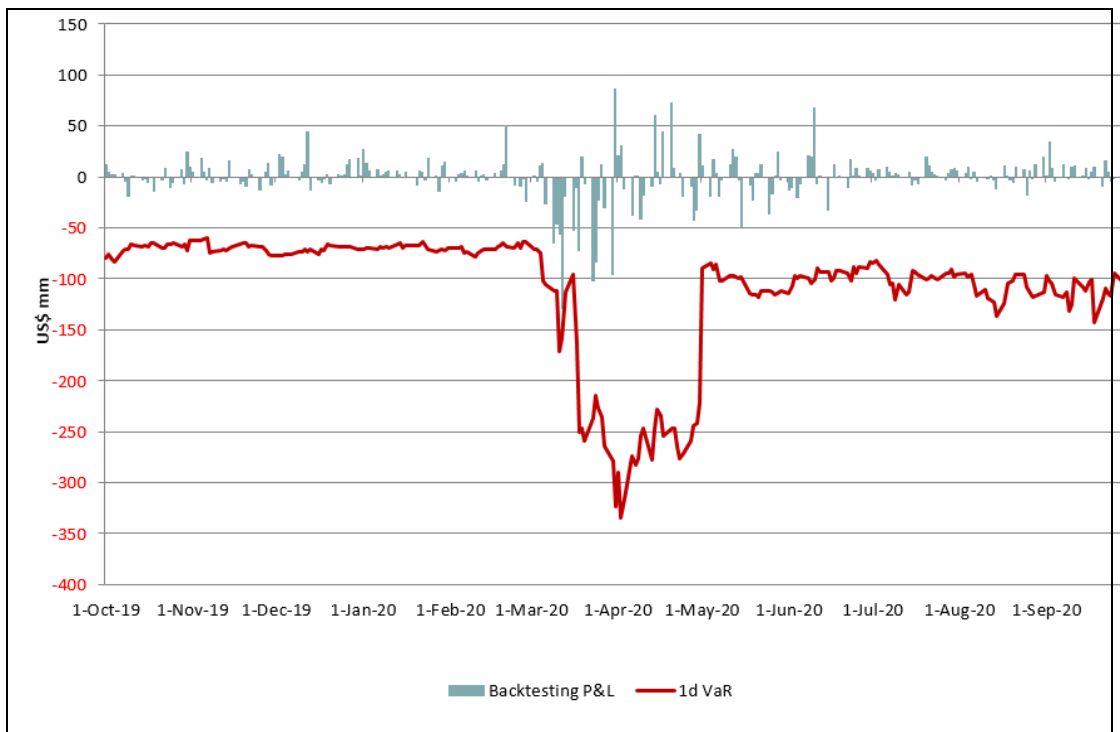
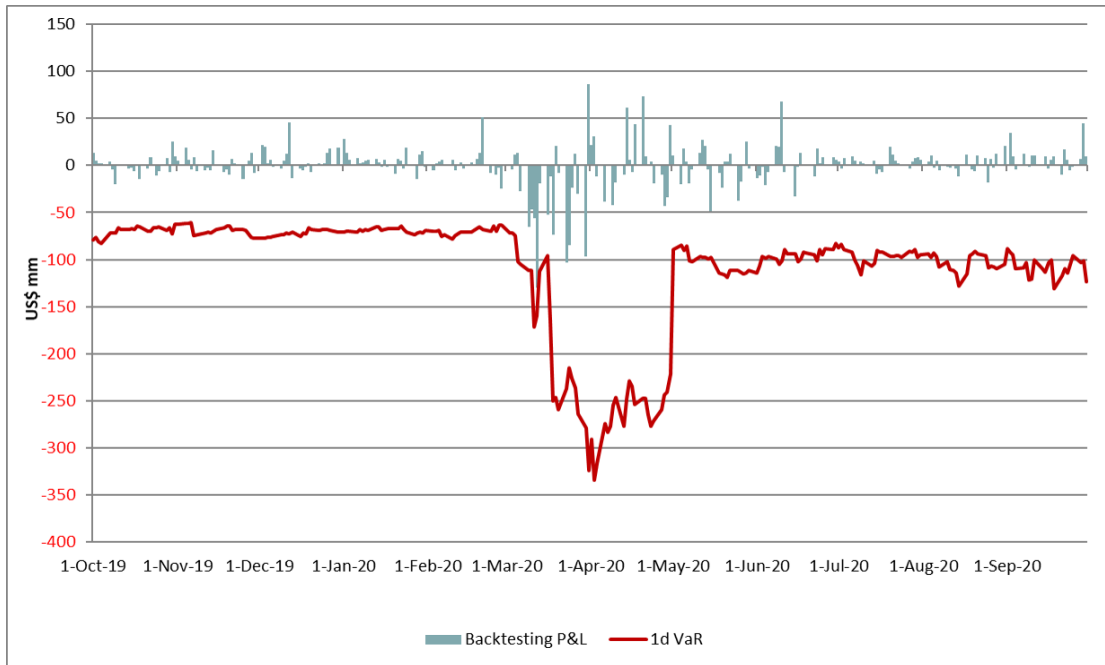
<訂正後>

（単位：百万円）

MR3：内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）			
項番		2020年9月末	2019年9月末
バリュアットリスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）			
2	平均値	45,817	21,454
4	期末	46,083	22,345
ストレス・バリュアットリスク（保有期間10営業日、片側信頼区間99%）			
6	平均値	29,395	36,359
7	最小値	17,911	22,740
8	期末	26,008	44,736
包括的リスクの額（片側信頼区間99.9%）			
17	フロア（修正標準的方式）	9,733	5,272

## MR 4 : 内部モデル方式のバック・テストの結果

<訂正前>



(8) マクロプルーデンス監督措置に関する事項

**CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況**

<訂正前>

(単位：百万円,%)

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
香港	1.00%	60,363		
ルクセンブルク	0.25%	174,199		
小計		234,562		
合計		5,635,684	0.01%	1,700,856

<訂正後>

(単位：百万円,%)

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
香港	1.00%	60,395		
ルクセンブルク	0.25%	176,574		
小計		236,970		
合計		5,661,071	0.01%	1,683,412

## 第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年9月末	2020年6月末	2019年9月末
オン・バランス資産の額(1)					
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>169,715</u>	<u>163,513</u>	156,926
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>22,766,530</u>	<u>23,161,459</u>	25,847,440
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額 (ホ)	<u>2,855,593</u>	<u>2,864,191</u>	2,691,284
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>48,731,347</u>	<u>48,053,266</u>	54,906,506
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)					
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>48,731,347</u>	<u>48,053,266</u>	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>51,383,294</u>	<u>50,058,277</u>	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年9月末	2020年6月末	2019年9月末
オン・バランス資産の額(1)					
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>169,979</u>	<u>163,353</u>	156,926
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>22,766,266</u>	<u>23,161,619</u>	25,847,440
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額 (ホ)	<u>2,855,329</u>	<u>2,864,351</u>	2,691,284
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>48,731,083</u>	<u>48,053,426</u>	54,906,506
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)					
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>48,731,083</u>	<u>48,053,426</u>	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>51,383,030</u>	<u>50,058,436</u>	



## 【2020年6月末】

### 第1章 自己資本の構成に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2020年6月末	2020年3月末	別紙様式第八号(CC2)の参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	<u>37,745</u>	41,562	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	<u>229,693</u>	245,481	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	<u>2,546,285</u>	2,404,634	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	<u>2,864,191</u>	2,571,500	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	<u>2,895,315</u>	2,602,379	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>16,077,794</u>	15,674,493	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>15.83%</u>	15.34%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>17.81%</u>	16.40%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>18.00%</u>	16.60%	
68	連結資本バッファ比率	<u>10.00%</u>	8.60%	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2020年6月末	2020年3月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
<b>普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)</b>				
12	適格引当金不足額	<u>37,585</u>	41,562	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	<u>229,533</u>	245,481	
<b>普通株式等Tier1 資本</b>				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	<u>2,546,444</u>	2,404,634	
<b>Tier1 資本</b>				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	<u>2,864,351</u>	2,571,500	
<b>総自己資本</b>				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	<u>2,895,475</u>	2,602,379	
<b>リスク・アセット(6)</b>				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>16,092,669</u>	15,674,493	
<b>連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)</b>				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>15.82%</u>	15.34%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>17.79%</u>	16.40%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>17.99%</u>	16.60%	
68	連結資本バッファ比率	<u>9.99%</u>	8.60%	

### 第3章 定量的な開示事項

#### (1) 主要な指標

##### KM1：主要な資料

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末	2019年9月末	2019年6月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,546,285</u>	2,404,634	2,534,259	2,524,353	2,478,315
2	Tier1資本の額	<u>2,864,191</u>	2,571,500	2,701,086	2,691,284	2,644,481
3	総自己資本の額	<u>2,895,315</u>	2,602,379	2,747,178	2,737,400	2,690,417
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>16,077,794</u>	15,674,493	14,028,085	14,576,989	14,626,406
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>15.83%</u>	15.34%	18.06%	17.31%	16.94%
6	連結Tier1比率	<u>17.81%</u>	16.40%	19.25%	18.46%	18.08%
7	連結総自己資本比率	<u>18.00%</u>	16.60%	19.58%	18.77%	18.39%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>10.00%</u>	8.60%	11.58%	10.77%	10.39%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>48,053,266</u>	53,135,763	55,692,934	54,906,506	52,235,865

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2020年6月末	2020年3月末	2019年12月末	2019年9月末	2019年6月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,546,444</u>	2,404,634	2,534,259	2,524,353	2,478,315
2	Tier1資本の額	<u>2,864,351</u>	2,571,500	2,701,086	2,691,284	2,644,481
3	総自己資本の額	<u>2,895,475</u>	2,602,379	2,747,178	2,737,400	2,690,417
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>16,092,669</u>	15,674,493	14,028,085	14,576,989	14,626,406
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>15.82%</u>	15.34%	18.06%	17.31%	16.94%
6	連結Tier1比率	<u>17.79%</u>	16.40%	19.25%	18.46%	18.08%
7	連結総自己資本比率	<u>17.99%</u>	16.60%	19.58%	18.77%	18.39%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>9.99%</u>	8.60%	11.58%	10.77%	10.39%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>48,053,426</u>	53,135,763	55,692,934	54,906,506	52,235,865

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

<訂正前>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,691,172</u>	3,591,776	<u>304,101</u>	297,422
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,172,079</u>	1,274,488	<u>99,392</u>	108,076
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>342,389</u>	314,711	<u>27,391</u>	25,176
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>16,077,794</u>	15,674,493	<u>1,286,223</u>	1,253,959

<訂正後>

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,705,362</u>	3,591,776	<u>305,291</u>	297,422
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,183,492</u>	1,274,488	<u>100,360</u>	108,076
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>345,165</u>	314,711	<u>27,613</u>	25,176
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>16,092,669</u>	15,674,493	<u>1,287,413</u>	1,253,959

(3) リスク・アセットの変動表

**CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセットの変動表**

<訂正前>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>△136,235</u>
3		取引相手方の信用力	<u>18,859</u>
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	<u>21,564</u>
7		為替の変動	<u>△4,053</u>
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,172,079</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット 変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	<u>△128,926</u>
3		取引相手方の信用力	<u>19,642</u>
4		モデルの更新（期待エクスポージャー方式に係る変動のみ）	<u>24,941</u>
7		為替の変動	<u>△4,109</u>
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,183,492</u>

## 第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年6月末	2020年3月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>163,513</u>	163,215
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>23,161,459</u>	25,569,400
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	<u>2,864,191</u>	2,571,500
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>48,053,266</u>	53,135,763
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>48,053,266</u>	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	<u>50,058,277</u>	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2020年6月末	2020年3月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>163,353</u>	163,215
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>23,161,619</u>	25,569,400
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	<u>2,864,351</u>	2,571,500
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>48,053,426</u>	53,135,763
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>48,053,426</u>	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	<u>50,058,436</u>	

以上