

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(2023年6月末・単体)

(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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	12,281,613	11,791,686	982,529	943,334
2	うち、標準的手法適用分	5,777,267	5,414,557	462,181	433,164
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,444,846	4,375,314	355,587	350,025
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,679,361	1,600,732	134,348	128,058
5	うち、先進的内部格付手法適用分	239,874	256,578	19,189	20,526
	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	140,263	144,504	11,221	11,560
6	カウンターパーティ信用リスク	299,543	239,291	23,963	19,143
7	うち、SA-CCR適用分	76,848	45,855	6,147	3,668
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	94,672	59,856	7,573	4,788
9	その他	128,022	133,579	10,241	10,686
10	CVAリスク	95,030	62,862	7,602	5,028
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	95,030	62,862	7,602	5,028
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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)	13,087,605	11,765,748	1,047,008	941,259
13	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(マニフェスト方式)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
	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%)	173,915	136,964	13,913	10,957
14	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%)	1,238,485	851,633	99,078	68,130
15	未決済取引	47,497	-	3,799	-
16	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	2,070,819	1,831,289	165,665	146,503
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	2,070,819	1,831,289	165,665	146,503
19	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	0	0	0	0
20	マーケット・リスク	5,197,837	1,573,493	415,826	125,879
21	うち、標準的方式適用分	5,197,837	1,573,493	415,826	125,879
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	991,603	991,603	79,328	79,328
25	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	1,216,356	1,017,521	97,308	81,401
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	36,700,307	30,262,094	2,936,024	2,420,967