

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(2025年6月末・連結)

(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	
		2025年6月末	2025年3月末	2025年6月末	2025年3月末
1	信用リスク	11,288,245	11,257,912	903,059	900,633
2	うち、標準的手法適用分	4,632,826	4,633,581	370,626	370,686
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,558,821	4,515,920	364,705	361,273
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	244,289	264,771	19,543	21,181
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,699,063	1,685,423	135,925	134,833
	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	153,243	158,215	12,259	12,657
6	カウンターパーティ信用リスク	164,750	207,169	13,180	16,573
7	うち、SA-CCR適用分	77,143	110,657	6,171	8,852
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	53,466	46,986	4,277	3,758
9	その他	34,140	49,526	2,731	3,962
10	CVAリスク	110,046	151,282	8,803	12,102
	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	110,046	151,282	8,803	12,102
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)	5,740,845	5,773,291	459,267	461,863
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(マンドート方式)	120,742	81,245	9,659	6,499
	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%)	133,485	108,045	10,678	8,643
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%)	169,779	221,181	13,582	17,694
15	未決済取引	-	22	-	1
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	2,548,845	2,457,931	203,907	196,634
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	2,548,845	2,457,931	203,907	196,634
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	4,341,996	3,487,433	347,359	278,994
21	うち、標準的方式適用分	4,341,996	3,487,433	347,359	278,994
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	2,203,383	2,203,383	176,270	176,270
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	144,345	146,713	11,547	11,737
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	26,966,465	26,095,613	2,157,317	2,087,649

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(2025年6月末・連結)

(単位:百万円)

CR8:内部格付手法を適用した信用リスク・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	6,466,115	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	222,514
3		ポートフォリオの質	△ 155,174
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	△ 31,281
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	6,502,174	

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(2025年6月末・連結)

(単位:百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛け目前)
1	信用リスク	6,502,174	4,632,826	11,135,001	18,017,604
2	カウンターパーティ信用リスク	111,284	53,466	164,750	260,192
3	CVAリスク		110,046	110,046	110,046
4	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				
		-	2,548,845	2,548,845	2,548,845
5	マーケット・リスク				
		-	4,341,996	4,341,996	4,341,996
6	オペレーショナル・リスク				
			2,203,383	2,203,383	2,203,383
7	その他リスク・アセット				
			6,462,442	6,462,442	7,932,225
8	合計	6,613,459	20,353,006	26,966,465	35,414,293