

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9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9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末
1	信用リスク	11,721,949	11,288,245	937,755	903,059
2	うち、標準的手法適用分	5,063,113	4,632,826	405,049	370,626
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,533,651	4,558,821	362,692	364,705
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	222,161	244,289	17,772	19,543
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,744,362	1,699,063	139,548	135,925
	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	158,660	153,243	12,692	12,259
6	カウンターパーティ信用リスク	208,297	164,750	16,663	13,180
7	うち、SA-CCR適用分	101,101	77,143	8,088	6,171
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	60,338	53,466	4,827	4,277
9	その他	46,857	34,140	3,748	2,731
10	CVAリスク	132,842	110,046	10,627	8,803
	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	132,842	110,046	10,627	8,803
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)	6,361,618	5,740,845	508,929	459,267
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)	237,189	120,742	18,975	9,659
	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%)	100,723	133,485	8,057	10,678
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%)	199,653	169,779	15,972	13,582
15	未決済取引	-	-	-	-
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	2,847,390	2,548,845	227,791	203,907
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	2,847,390	2,548,845	227,791	203,907
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	3,764,395	4,341,996	301,151	347,359
21	うち、標準的方式適用分	3,764,395	4,341,996	301,151	347,359
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	147,072	144,345	11,765	11,547
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	27,924,516	26,966,465	2,233,961	2,157,317

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9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	6,502,174	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	215,135
3		ポートフォリオの質	△ 276,706
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	59,571
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	6,500,175	

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9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	6,500,175	5,063,113	11,563,288	18,612,753
2	カウンターパーティ信用リスク	147,958	60,338	208,297	332,571
3	CVAリスク		132,842	132,842	132,842
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		2,847,390	2,847,390	2,847,390
5	マーケット・リスク		3,764,395	3,764,395	3,764,395
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		7,204,917	7,204,917	8,739,786
8	合計	6,648,134	21,276,382	27,924,516	36,633,123