

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(2026年3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	
		2026年3月末	2025年12月末	2026年3月末	2025年12月末
1	信用リスク	12,354,409	12,333,881	988,352	986,710
2	うち、標準的手法適用分	5,483,413	5,481,029	438,673	438,482
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,728,542	4,727,660	378,283	378,212
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	197,839	202,372	15,827	16,189
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,786,534	1,755,216	142,922	140,417
	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	158,079	167,602	12,646	13,408
6	カウンターパーティ信用リスク	204,427	192,549	16,354	15,403
7	うち、SA-CCR適用分	89,253	74,600	7,140	5,968
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	62,983	61,882	5,038	4,950
9	その他	52,191	56,067	4,175	4,485
10	CVAリスク	113,356	97,798	9,068	7,823
	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	113,356	97,798	9,068	7,823
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)	7,216,264	7,078,080	577,301	566,246
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)	212,332	275,469	16,986	22,037
	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%)	91,778	160,353	7,342	12,828
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%)	236,428	179,571	18,914	14,365
15	未決済取引	-	566	-	45
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	3,073,229	2,974,281	245,858	237,942
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	3,073,229	2,974,281	245,858	237,942
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	2,921,037	3,928,520	233,683	314,281
21	うち、標準的方式適用分	2,921,037	3,928,520	233,683	314,281
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	2,032,943	2,203,383	162,635	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	156,996	107,295	12,559	8,583
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	28,613,206	29,531,752	2,289,056	2,362,540

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(2026年3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	6,685,249	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	97,680
3		ポートフォリオの質	△ 113,073
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	43,060
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	6,712,916	

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(2026年3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(フロア掛目前)
1	信用リスク	6,712,916	5,483,413	12,196,329	19,610,318
2	カウンターパーティ信用リスク	141,444	62,983	204,427	349,409
3	CVAリスク		113,356	113,356	113,356
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		3,073,229	3,073,229	3,073,229
5	マーケット・リスク		2,921,037	2,921,037	2,921,037
6	オペレーショナル・リスク		2,032,943	2,032,943	2,032,943
7	その他リスク・アセット		8,071,880	8,071,880	9,443,661
8	合計	6,854,361	21,758,845	28,613,206	37,543,958