

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12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	
		2023年12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	12,119,412	12,749,792	969,553	1,019,983
2	うち、標準的手法適用分	4,653,961	5,171,681	372,316	413,734
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,953,195	5,018,600	396,255	401,488
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,081,830	2,136,835	166,546	170,946
5	うち、先進的内部格付手法適用分	270,325	275,872	21,626	22,069
	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	160,099	146,802	12,807	11,744
6	カウンターパーティ信用リスク	296,454	250,109	23,716	20,008
7	うち、SA-CCR適用分	111,786	79,854	8,942	6,388
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	94,524	105,598	7,561	8,447
9	その他	90,143	64,656	7,211	5,172
10	CVAリスク	137,261	94,485	10,980	7,558
	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	137,261	94,485	10,980	7,558
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(レック・スルー方式)	10,066,522	11,267,310	805,321	901,384
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)	-	-	-	-
	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%)	192,620	125,836	15,409	10,066
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%)	789,091	812,700	63,127	65,016
15	未決済取引	114	-	9	-
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	2,165,104	2,226,653	173,208	178,132
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	2,165,104	2,226,653	173,208	178,132
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	820,930	863,410	65,674	69,072
21	うち、標準的方式適用分	820,930	863,410	65,674	69,072
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	1,046,324	1,046,324	83,705	83,705
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	1,188,906	1,248,105	95,112	99,848
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	28,822,743	30,684,728	2,305,819	2,454,778

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12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	7,431,308	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	43,110
3		ポートフォリオの質	△ 58,588
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	△ 110,478
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	7,305,351	

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12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	7,305,351	4,653,961	11,959,313	17,983,441
2	カウンターパーティ信用リスク	201,930	94,524	296,454	489,600
3	CVAリスク		137,261	137,261	137,261
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	-	2,165,104	2,165,104	2,165,104
5	マーケット・リスク	-	820,930	820,930	820,930
6	オペレーショナル・リスク		1,046,324	1,046,324	1,046,324
7	その他リスク・アセット		12,397,355	12,397,355	14,251,759
8	合計	7,507,282	21,315,461	28,822,743	36,894,421