

## 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(2024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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	11,415,797	12,119,412	913,263	969,553
2	うち、標準的手法適用分	4,293,052	4,653,961	343,444	372,316
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,543,895	4,953,195	363,511	396,255
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,160,531	2,081,830	172,842	166,546
5	うち、先進的内部格付手法適用分	253,489	270,325	20,279	21,626
	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	164,828	160,099	13,186	12,807
6	カウンターパーティ信用リスク	275,817	296,454	22,065	23,716
7	うち、SA-CCR適用分	117,069	111,786	9,365	8,942
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	92,956	94,524	7,436	7,561
9	その他	65,791	90,143	5,263	7,211
10	CVAリスク	145,623	137,261	11,649	10,980
	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	145,623	137,261	11,649	10,980
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)	9,110,688	10,066,522	728,855	805,321
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%)	141,348	192,620	11,307	15,409
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%)	730,595	789,091	58,447	63,127
15	未決済取引	2,391	114	191	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	2,162,809	2,165,104	173,024	173,208
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	2,162,809	2,165,104	173,024	173,208
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	765,047	820,930	61,203	65,674
21	うち、標準的方式適用分	765,047	820,930	61,203	65,674
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	1,612,711	1,046,324	129,016	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	111,488	1,188,906	8,919	95,112
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	26,474,319	28,822,743	2,117,945	2,305,819

## 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(2024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	7,305,351	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	△ 79,699
3		ポートフォリオの質	△ 83,979
4		モデルの更新	△ 359,823
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	176,067
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	6,957,916	

注: 項番4 モデルの更新の変動は、PD推計手法の見直しによるもの。

## 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(2024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(フロア掛け目前)
1	信用リスク	6,957,916	4,293,052	11,250,968	17,382,922
2	カウンターパーティ信用リスク	182,861	92,956	275,817	428,185
3	CVAリスク		145,623	145,623	145,623
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	-	2,162,809	2,162,809	2,162,809
5	マーケット・リスク	-	765,047	765,047	765,047
6	オペレーショナル・リスク		1,612,711	1,612,711	1,612,711
7	その他リスク・アセット		10,261,341	10,261,341	12,415,023
8	合計	7,140,777	19,333,542	26,474,319	34,912,323