

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	
		2024年6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	11,570,601	11,415,797	925,648	913,263
2	うち、標準的手法適用分	4,347,683	4,293,052	347,814	343,444
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,628,172	4,543,895	370,253	363,511
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,199,262	2,160,531	175,940	172,842
5	うち、先進的内部格付手法適用分	252,499	253,489	20,199	20,279
	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	142,983	164,828	11,438	13,186
6	カウンターパーティ信用リスク	231,973	275,817	18,557	22,065
7	うち、SA-CCR適用分	86,049	117,069	6,883	9,365
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	81,385	92,956	6,510	7,436
9	その他	64,538	65,791	5,163	5,263
10	CVAリスク	111,716	145,623	8,937	11,649
	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	111,716	145,623	8,937	11,649
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)	8,597,897	9,110,688	687,831	728,855
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(マニフェスト方式)	-	-	-	-
	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%)	234,223	141,348	18,737	11,307
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%)	785,692	730,595	62,855	58,447
15	未決済取引	8,030	2,391	642	191
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	2,178,759	2,162,809	174,300	173,024
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	2,178,759	2,162,809	174,300	173,024
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	535,062	765,047	42,805	61,203
21	うち、標準的方式適用分	535,062	765,047	42,805	61,203
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	1,612,711	129,016	129,016
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	110,086	111,488	8,806	8,919
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	25,976,756	26,474,319	2,078,140	2,117,945

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	6,957,916	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	57,622
3		ポートフォリオの質	△ 146,708
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	211,070
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	7,079,934	

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	7,079,934	4,347,683	11,427,618	17,779,121
2	カウンターパーティ信用リスク	150,588	81,385	231,973	354,859
3	CVAリスク		111,716	111,716	111,716
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	-	2,178,759	2,178,759	2,178,759
5	マーケット・リスク	-	535,062	535,062	535,062
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		9,878,913	9,878,913	11,850,965
8	合計	7,230,523	18,746,232	25,976,756	34,423,197