

## 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	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	11,562,393	11,570,601	924,991	925,648
2	うち、標準的手法適用分	4,490,433	4,347,683	359,234	347,814
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,529,911	4,628,172	362,392	370,253
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,148,681	2,199,262	171,894	175,940
5	うち、先進的内部格付手法適用分	249,955	252,499	19,996	20,199
	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	143,411	142,983	11,472	11,438
6	カウンターパーティ信用リスク	292,519	231,973	23,401	18,557
7	うち、SA-CCR適用分	144,245	86,049	11,539	6,883
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	67,186	81,385	5,374	6,510
9	その他	81,086	64,538	6,486	5,163
10	CVAリスク	193,902	111,716	15,512	8,937
	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	193,902	111,716	15,512	8,937
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)	6,755,699	8,597,897	540,455	687,831
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%)	110,899	234,223	8,871	18,737
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%)	692,005	785,692	55,360	62,855
15	未決済取引	2,354	8,030	188	642
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	1,995,926	2,178,759	159,674	174,300
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	1,995,926	2,178,759	159,674	174,300
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	2,366,019	535,062	189,281	42,805
21	うち、標準的方式適用分	2,366,019	535,062	189,281	42,805
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	112,088	110,086	8,967	8,806
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	25,696,520	25,976,756	2,055,721	2,078,140

## 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	7,079,934	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	246,290
3		ポートフォリオの質	△ 70,807
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	△ 326,869
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	6,928,548	

## 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	6,928,548	4,490,433	11,418,981	17,389,807
2	カウンターパーティ信用リスク	225,332	67,186	292,519	484,872
3	CVAリスク		193,902	193,902	193,902
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	-	1,995,926	1,995,926	1,995,926
5	マーケット・リスク	-	2,366,019	2,366,019	2,366,019
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		7,816,458	7,816,458	9,215,680
8	合計	7,153,881	18,542,638	25,696,520	33,258,920