

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 | |
| | | 2024年12月末 | 2024年9月末 | 2024年12月末 | 2024年9月末 |
| 1 | 信用リスク | 11,654,877 | 11,562,393 | 932,390 | 924,991 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 4,579,076 | 4,490,433 | 366,326 | 359,234 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 4,486,129 | 4,529,911 | 358,890 | 362,392 |
| 4 | うち、スロットティング・クライテリア適用分 | 2,182,569 | 2,148,681 | 174,605 | 171,894 |
| 5 | うち、先進的内部格付手法適用分 | 248,104 | 249,955 | 19,848 | 19,996 |
| | 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 | 158,997 | 143,411 | 12,719 | 11,472 |
| 6 | カウンターパーティ信用リスク | 196,816 | 292,519 | 15,745 | 23,401 |
| 7 | うち、SA-CCR適用分 | 74,082 | 144,245 | 5,926 | 11,539 |
| 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 | 49,880 | 67,186 | 3,990 | 5,374 |
| 9 | その他 | 72,854 | 81,086 | 5,828 | 6,486 |
| 10 | CVAリスク | 98,637 | 193,902 | 7,891 | 15,512 |
| | 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 | 98,637 | 193,902 | 7,891 | 15,512 |
| 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) | 6,787,428 | 6,755,699 | 542,994 | 540,455 |
| 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) | 42,191 | - | 3,375 | - |
| | 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%) | 155,116 | 110,899 | 12,409 | 8,871 |
| 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%) | 773,518 | 692,005 | 61,881 | 55,360 |
| 15 | 未決済取引 | 18,126 | 2,354 | 1,450 | 188 |
| 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 | 2,453,308 | 1,995,926 | 196,264 | 159,674 |
| 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 | 2,453,308 | 1,995,926 | 196,264 | 159,674 |
| 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 | 2,469,664 | 2,366,019 | 197,573 | 189,281 |
| 21 | うち、標準的方式適用分 | 2,469,664 | 2,366,019 | 197,573 | 189,281 |
| 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 | 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 | 115,094 | 112,088 | 9,207 | 8,967 |
| 26 | フロア調整 | - | - | - | - |
| 27 | 合計 | 26,377,493 | 25,696,520 | 2,110,199 | 2,055,721 |

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 | 6,928,548 | |
| 2 | 当四半期中 の要因別の 変動額 | 資産の規模 | △ 76,957 |
| 3 | | ポートフォリオの質 | △ 142,864 |
| 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 | 208,077 |
| 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 | 6,916,803 | |

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 | 6,916,803 | 4,579,076 | 11,495,879 | 17,997,216 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 146,936 | 49,880 | 196,816 | 453,406 |
| 3 | CVAリスク | | 98,637 | 98,637 | 98,637 |
| 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 | - | 2,453,308 | 2,453,308 | 2,453,308 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 2,469,664 | 2,469,664 | 2,469,664 |
| 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 | | 8,050,473 | 8,050,473 | 9,671,934 |
| 8 | 合計 | 7,063,740 | 19,313,753 | 26,377,493 | 34,756,881 |