

## 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(2022年12月末・単体)

(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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	7,927,756	8,017,204	671,558	679,174
2	うち、標準的手法適用分	10,767	7,489	861	599
3	うち、内部格付手法適用分	7,778,828	7,874,696	659,644	667,774
	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	138,160	135,018	11,052	10,801
4	カウンターパーティ信用リスク	634,625	682,544	52,133	55,980
5	うち、SA-CCR適用分	124,983	80,364	10,598	6,814
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	116,688	79,506	9,335	6,360
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	233,958	316,127	18,716	25,290
	その他	158,994	206,546	13,482	17,515
7	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	3,660,233	4,073,636	310,387	345,444
8	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)	16,079,713	18,793,419	1,363,500	1,593,610
9	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%)	172,574	175,867	14,634	14,913
10	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%)	910,492	888,013	72,839	71,041
11	未決済取引	-	158,373	-	13,430
12	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	1,840,736	1,890,780	147,258	151,262
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	1,840,736	1,890,780	147,258	151,262
15	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
16	マーケット・リスク	1,338,304	1,780,293	107,064	142,423
17	うち、標準的方式適用分	1,326,995	1,776,031	106,159	142,082
18	うち、内部モデル方式適用分	11,308	4,261	904	340
19	オペレーショナル・リスク	790,677	790,677	63,254	63,254
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	790,677	790,677	63,254	63,254
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	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	1,327,722	1,323,194	112,590	112,206
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額				
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	34,682,834	38,574,003	2,915,221	3,242,742