

## 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(2023年9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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	11,959,345	12,281,613	956,747	982,529
2	うち、標準的手法適用分	5,639,829	5,777,267	451,186	462,181
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,180,210	4,444,846	334,416	355,587
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,760,209	1,679,361	140,816	134,348
5	うち、先進的内部格付手法適用分	240,760	239,874	19,260	19,189
	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	138,335	140,263	11,066	11,221
6	カウンターパーティ信用リスク	346,635	299,543	27,730	23,963
7	うち、SA-CCR適用分	79,854	76,848	6,388	6,147
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	99,327	94,672	7,946	7,573
9	その他	167,453	128,022	13,396	10,241
10	CVAリスク	94,485	95,030	7,558	7,602
	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	94,485	95,030	7,558	7,602
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)	11,901,628	13,087,605	952,130	1,047,008
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%)	124,862	173,915	9,989	13,913
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%)	809,778	1,238,485	64,782	99,078
15	未決済取引	53	47,497	4	3,799
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	2,226,653	2,070,819	178,132	165,665
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	2,226,653	2,070,819	178,132	165,665
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	861,940	5,197,837	68,955	415,826
21	うち、標準的方式適用分	861,940	5,197,837	68,955	415,826
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	991,603	991,603	79,328	79,328
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	1,187,749	1,216,356	95,019	97,308
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	30,504,737	36,700,307	2,440,378	2,936,024