

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	
		2023年12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	11,290,591	11,959,345	903,247	956,747
2	うち、標準的手法適用分	5,114,038	5,639,829	409,123	451,186
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,087,559	4,180,210	327,004	334,416
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,705,986	1,760,209	136,478	140,816
5	うち、先進的内部格付手法適用分	234,868	240,760	18,789	19,260
	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	148,138	138,335	11,851	11,066
6	カウンターパーティ信用リスク	382,363	346,635	30,589	27,730
7	うち、SA-CCR適用分	111,786	79,854	8,942	6,388
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	88,478	99,327	7,078	7,946
9	その他	182,098	167,453	14,567	13,396
10	CVAリスク	137,261	94,485	10,980	7,558
	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	137,261	94,485	10,980	7,558
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)	10,694,792	11,901,628	855,583	952,130
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%)	191,083	124,862	15,286	9,989
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%)	786,612	809,778	62,929	64,782
15	未決済取引	114	53	9	4
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	2,165,104	2,226,653	173,208	178,132
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	2,165,104	2,226,653	173,208	178,132
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	818,279	861,940	65,462	68,955
21	うち、標準的方式適用分	818,279	861,940	65,462	68,955
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	1,251,855	1,187,749	100,148	95,019
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	28,709,663	30,504,737	2,296,773	2,440,378