

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3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 | |
| | | 2024年3月末 | 2023年12月末 | 2024年3月末 | 2023年12月末 |
| 1 | 信用リスク | 10,641,182 | 11,290,591 | 851,294 | 903,247 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 4,761,667 | 5,114,038 | 380,933 | 409,123 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 3,723,444 | 4,087,559 | 297,875 | 327,004 |
| 4 | うち、スロッシング・クライテリア適用分 | 1,774,396 | 1,705,986 | 141,951 | 136,478 |
| 5 | うち、先進的内部格付手法適用分 | 224,338 | 234,868 | 17,947 | 18,789 |
| | 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 | 157,334 | 148,138 | 12,586 | 11,851 |
| 6 | カウンターパーティ信用リスク | 349,067 | 382,363 | 27,925 | 30,589 |
| 7 | うち、SA-CCR適用分 | 117,069 | 111,786 | 9,365 | 8,942 |
| 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 | 85,964 | 88,478 | 6,877 | 7,078 |
| 9 | その他 | 146,033 | 182,098 | 11,682 | 14,567 |
| 10 | CVAリスク | 145,623 | 137,261 | 11,649 | 10,980 |
| | 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 | 145,623 | 137,261 | 11,649 | 10,980 |
| 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) | 9,720,052 | 10,694,792 | 777,604 | 855,583 |
| 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%) | 137,389 | 191,083 | 10,991 | 15,286 |
| 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%) | 728,848 | 786,612 | 58,307 | 62,929 |
| 15 | 未決済取引 | 2,391 | 114 | 191 | 9 |
| 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 | 2,162,809 | 2,165,104 | 173,024 | 173,208 |
| 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 | 2,162,809 | 2,165,104 | 173,024 | 173,208 |
| 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 | 764,807 | 818,279 | 61,184 | 65,462 |
| 21 | うち、標準的方式適用分 | 764,807 | 818,279 | 61,184 | 65,462 |
| 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 | 1,591,616 | 991,603 | 127,329 | 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 | 178,443 | 1,251,855 | 14,275 | 100,148 |
| 26 | フロア調整 | - | - | - | - |
| 27 | 合計 | 26,422,230 | 28,709,663 | 2,113,778 | 2,296,773 |