

## 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6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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	10,720,449	10,641,182	857,635	851,294
2	うち、標準的手法適用分	4,785,585	4,761,667	382,846	380,933
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,796,959	3,723,444	303,756	297,875
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,782,702	1,774,396	142,616	141,951
5	うち、先進的内部格付手法適用分	220,840	224,338	17,667	17,947
	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	134,361	157,334	10,748	12,586
6	カウンターパーティ信用リスク	295,949	349,067	23,675	27,925
7	うち、SA-CCR適用分	86,049	117,069	6,883	9,365
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	76,126	85,964	6,090	6,877
9	その他	133,773	146,033	10,701	11,682
10	CVAリスク	111,716	145,623	8,937	11,649
	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	111,716	145,623	8,937	11,649
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)	9,196,955	9,720,052	735,756	777,604
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%)	230,766	137,389	18,461	10,991
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%)	783,473	728,848	62,677	58,307
15	未決済取引	8,034	2,391	642	191
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	2,178,759	2,162,809	174,300	173,024
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	2,178,759	2,162,809	174,300	173,024
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	534,402	764,807	42,752	61,184
21	うち、標準的方式適用分	534,402	764,807	42,752	61,184
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	1,591,616	127,329	127,329
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	70,499	178,443	5,639	14,275
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	25,722,622	26,422,230	2,057,809	2,113,778