

## 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	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	10,671,988	10,720,449	853,759	857,635
2	うち、標準的手法適用分	4,908,020	4,785,585	392,641	382,846
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,650,451	3,796,959	292,036	303,756
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,766,978	1,782,702	141,358	142,616
5	うち、先進的内部格付手法適用分	211,193	220,840	16,895	17,667
	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	135,344	134,361	10,827	10,748
6	カウンターパーティ信用リスク	386,175	295,949	30,894	23,675
7	うち、SA-CCR適用分	144,245	86,049	11,539	6,883
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	63,102	76,126	5,048	6,090
9	その他	178,827	133,773	14,306	10,701
10	CVAリスク	193,902	111,716	15,512	8,937
	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	193,902	111,716	15,512	8,937
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)	7,347,837	9,196,955	587,827	735,756
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%)	107,481	230,766	8,598	18,461
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%)	689,817	783,473	55,185	62,677
15	未決済取引	2,354	8,034	188	642
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	1,995,926	2,178,759	159,674	174,300
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	1,995,926	2,178,759	159,674	174,300
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	2,362,137	534,402	188,971	42,752
21	うち、標準的方式適用分	2,362,137	534,402	188,971	42,752
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	70,499	5,639	5,639
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	25,419,736	25,722,622	2,033,578	2,057,809