

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	
		2024年12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
1	信用リスク	10,877,196	10,671,988	870,175	853,759
2	うち、標準的手法適用分	5,037,583	4,908,020	403,006	392,641
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,664,084	3,650,451	293,126	292,036
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	1,818,249	1,766,978	145,459	141,358
5	うち、先進的内部格付手法適用分	209,463	211,193	16,757	16,895
	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	147,815	135,344	11,825	10,827
6	カウンターパーティ信用リスク	288,780	386,175	23,102	30,894
7	うち、SA-CCR適用分	74,082	144,245	5,926	11,539
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	47,593	63,102	3,807	5,048
9	その他	167,105	178,827	13,368	14,306
10	CVAリスク	98,637	193,902	7,891	15,512
	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	98,637	193,902	7,891	15,512
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)	7,393,687	7,347,837	591,494	587,827
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(マデット方式)	42,191	-	3,375	-
	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%)	151,688	107,481	12,135	8,598
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%)	762,729	689,817	61,018	55,185
15	未決済取引	18,126	2,354	1,450	188
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	2,453,308	1,995,926	196,264	159,674
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	2,453,308	1,995,926	196,264	159,674
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	2,465,740	2,362,137	197,259	188,971
21	うち、標準的方式適用分	2,465,740	2,362,137	197,259	188,971
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	26,214,203	25,419,736	2,097,136	2,033,578