

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3月末・連結)

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	12,429,894		994,391	
2	うち、標準的手法適用分	4,874,027		389,922	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	5,168,704		413,496	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	1,960,349		156,827	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	273,593		21,887	
	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	153,220		12,257	
6	カウンターパーティ信用リスク	172,869		13,829	
7	うち、SA-CCR適用分	45,855		3,668	
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	65,728		5,258	
9	その他	61,284		4,902	
10	CVAリスク	62,862		5,028	
	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	62,862		5,028	
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)	11,154,871		892,389	
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%)	137,860		11,028	
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%)	851,621		68,129	
15	未決済取引	-		-	
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	1,831,289		146,503	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	1,831,289		146,503	
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	-		-	
20	マーケット・リスク	1,573,558		125,884	
21	うち、標準的方式適用分	1,573,558		125,884	
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	1,046,324		83,705	
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	999,092		79,927	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	30,260,243		2,420,819	

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3月末・連結)

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク		9,470,611		801,223
2	うち、標準的手法適用分		253,826		20,306
3	うち、内部格付手法適用分		9,078,109		769,823
	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		138,675		11,094
4	カウンターパーティ信用リスク		557,143		45,541
5	うち、SA-CCR適用分		124,983		10,598
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		116,688		9,335
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		238,404		19,072
	その他		77,067		6,535
7	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		3,681,447		312,186
8	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)		15,291,444		1,296,654
9	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%)		173,478		14,710
10	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%)		910,555		72,844
11	未決済取引		-		-
12	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		1,840,736		147,258
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		-		-
14	うち、外部格付準拠方式適用分		1,840,736		147,258
15	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
16	マーケット・リスク		1,338,398		107,071
17	うち、標準的方式適用分		1,327,089		106,167
18	うち、内部モデル方式適用分		11,308		904
19	オペレーショナル・リスク		836,435		66,914
20	うち、基礎的手法適用分		-		-
21	うち、粗利益配分手法適用分		836,435		66,914
22	うち、先進的計測手法適用分		-		-
23	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		1,380,015		117,025
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額				
24	フロア調整		-		-
25	合計		35,480,267		2,981,433

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3月末・連結)

(単位:百万円)

CR8:内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	9,078,109	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	16,843
3		ポートフォリオの質	△ 18,804
4		モデルの更新	△ 297,368
5		手法及び方針	△ 1,412,743
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	36,609
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	7,402,646	

(注)手法及び方針の変動は、バーゼルⅢ規制見直しの最終化を早期適用したことに伴い、計算手法の一部を変更したことが要因です。

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3月末・連結)

(単位:百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛け目前)
1	信用リスク	7,402,646	4,874,027	12,276,673	17,989,179
2	カウンターパーティ信用リスク	107,140	65,728	172,869	276,254
3	CVAリスク		62,862	62,862	62,862
4	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	-	1,831,289	1,831,289	1,831,289
5	マーケット・リスク	-	1,573,558	1,573,558	1,573,558
6	オペレーショナル・リスク		1,046,324	1,046,324	1,046,324
7	その他リスク・アセット		13,296,665	13,296,665	14,819,367
8	合計	7,509,787	22,750,456	30,260,243	37,598,835