

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6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6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	12,954,838	12,429,894	1,036,387	994,391
2	うち、標準的手法適用分	5,248,496	4,874,027	419,879	389,922
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	5,236,337	5,168,704	418,906	413,496
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	2,056,166	1,960,349	164,493	156,827
5	うち、先進的内部格付手法適用分	264,891	273,593	21,191	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	148,947	153,220	11,915	12,257
6	カウンターパーティ信用リスク	240,704	172,869	19,256	13,829
7	うち、SA-CCR適用分	76,848	45,855	6,147	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	100,293	65,728	8,023	5,258
9	その他	63,562	61,284	5,084	4,902
10	CVAリスク	95,030	62,862	7,602	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	95,030	62,862	7,602	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)	12,457,189	11,154,871	996,575	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%)	175,204	137,860	14,016	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%)	1,238,860	851,621	99,108	68,129
15	未決済取引	47,497	-	3,799	-
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	2,070,819	1,831,289	165,665	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	2,070,819	1,831,289	165,665	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	0	0	0	0
20	マーケット・リスク	5,199,492	1,573,558	415,959	125,884
21	うち、標準的方式適用分	5,199,492	1,573,558	415,959	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	1,046,324	83,705	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	1,190,092	999,092	95,207	79,927
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	36,716,053	30,260,243	2,937,284	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6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	7,402,646	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	75,184
3		ポートフォリオの質	△ 181,592
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	261,156
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	7,557,395	

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6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	7,557,395	5,248,496	12,805,891	18,924,152
2	カウンターパーティ信用リスク	140,411	100,293	240,704	337,909
3	CVAリスク		95,030	95,030	95,030
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	-	2,070,819	2,070,819	2,070,819
5	マーケット・リスク	-	5,199,492	5,199,492	5,199,492
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		15,257,792	15,257,792	17,238,583
8	合計	7,697,806	29,018,247	36,716,053	44,912,311