

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(2022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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	8,017,204	7,643,997	679,174	647,546
2	うち、標準的手法適用分	7,489	4,658	599	372
3	うち、内部格付手法適用分	7,874,696	7,505,578	667,774	636,473
	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	135,018	133,759	10,801	10,700
4	カウンターパーティ信用リスク	682,544	618,191	55,980	50,760
5	うち、SA-CCR適用分	80,364	93,464	6,814	7,925
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	79,506	91,335	6,360	7,306
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	316,127	254,906	25,290	20,392
	その他	206,546	178,485	17,515	15,135
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	4,073,636	3,786,937	345,444	321,132
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)	18,793,419	19,053,428	1,593,610	1,615,677
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%)	175,867	163,711	14,913	13,882
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%)	888,013	608,938	71,041	48,715
11	未決済取引	158,373	173,366	13,430	14,701
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	1,890,780	1,718,310	151,262	137,464
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	1,890,780	1,718,310	151,262	137,464
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	0	0
16	マーケット・リスク	1,780,293	1,889,706	142,423	151,176
17	うち、標準的方式適用分	1,776,031	1,887,304	142,082	150,984
18	うち、内部モデル方式適用分	4,261	2,401	340	192
19	オペレーショナル・リスク	790,677	790,677	63,254	63,254
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	790,677	790,677	63,254	63,254
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	1,323,194	382,910	112,206	32,470
	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	38,574,003	36,830,177	3,242,742	3,096,782