

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月期自己資本比率)

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (連結)					
国際様式の 該当番号 (注)		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2022年9月期)	前四半期末 (2022年6月期)	当四半期末 (2022年9月期)	前四半期末 (2022年6月期)
1	信用リスク	2,483,657	2,580,835	210,367	218,586
2	うち、標準的手法適用分	10,536	8,888	842	711
3	うち、内部格付手法適用分	2,432,169	2,524,974	206,247	214,117
	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	3,616	3,642	289	291
	その他	37,335	43,330	2,986	3,466
4	カウンターパーティ信用リスク	97,495	95,436	8,004	7,858
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	14,448	13,665	1,225	1,158
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	53,778	47,725	4,302	3,818
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,036	1,054	82	84
	その他	28,232	32,991	2,394	2,797
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	254,333	304,986	21,567	25,862
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)	195,813	205,569	15,665	16,445
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%)	33,252	31,974	2,819	2,711
	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%)	67,360	58,922	5,712	4,996
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%)	857,149	771,097	68,571	61,687
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	30,332	30,426	2,426	2,434
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	30,332	30,426	2,426	2,434
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	183,255	180,660	14,660	14,452
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	183,255	180,660	14,660	14,452
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	560	560	47	47
	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	4,203,209	4,260,468	349,842	355,084

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (単体)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2022年9月期)	前四半期末 (2022年6月期)	当四半期末 (2022年9月期)	前四半期末 (2022年6月期)
1	信用リスク	2,421,656	2,514,208	205,189	213,016
2	うち、標準的手法適用分	6,778	5,400	542	432
3	うち、内部格付手法適用分	2,386,833	2,474,996	202,403	209,879
	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	28,044	33,811	2,243	2,704
4	カウンターパーティ信用リスク	97,495	95,436	8,004	7,858
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	14,448	13,665	1,225	1,158
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	53,778	47,725	4,302	3,818
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,036	1,054	82	84
	その他	28,232	32,991	2,394	2,797
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	269,918	320,508	22,889	27,179
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)	223,644	233,420	17,891	18,673
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%)	33,217	31,936	2,816	2,708
	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%)	67,206	58,748	5,699	4,981
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%)	854,557	768,401	68,364	61,472
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	30,332	30,426	2,426	2,434
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	30,332	30,426	2,426	2,434
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
18	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
19	オペレーショナル・リスク	154,923	152,168	12,393	12,173
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	154,923	152,168	12,393	12,173
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	—	—	—	—
	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	4,152,952	4,205,256	345,675	350,498

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。