

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 (2023年3月期)	前四半期末 (2022年12月期)	当四半期末 (2023年3月期)	前四半期末 (2022年12月期)
1	信用リスク	2,661,894	2,526,385	225,503	214,000
2	うち、標準的手法適用分	5,721	6,636	457	530
3	うち、内部格付手法適用分	2,614,942	2,476,951	221,747	210,045
	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	3,722	3,705	297	296
	その他	37,508	39,092	3,000	3,127
4	カウンターパーティ信用リスク	49,234	84,961	4,083	7,001
5	うち、SA-CCR適用分	8,844	—	749	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	14,960	—	1,268
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,985	40,912	1,438	3,273
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,093	1,403	87	112
	その他	21,311	27,684	1,807	2,347
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	276,072	249,606	23,410	21,166
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)	193,117	192,918	15,449	15,433
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)	4,770	—	381	—
	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%)	14,530	26,669	1,232	2,261
	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%)	24,189	68,352	2,051	5,796
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%)	788,588	836,169	63,087	66,893
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	36,655	30,652	2,932	2,452
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	36,655	30,652	2,932	2,452
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	183,790	183,255	14,703	14,660
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	183,790	183,255	14,703	14,660
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	4,233,403	4,199,532	352,882	349,713

(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 (2023年3月期)	前四半期末 (2022年12月期)	当四半期末 (2023年3月期)	前四半期末 (2022年12月期)
1	信用リスク	2,594,997	2,458,660	219,911	208,342
2	うち、標準的手法適用分	2,587	2,916	207	233
3	うち、内部格付手法適用分	2,564,873	2,426,963	217,501	205,806
	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	27,536	28,780	2,202	2,302
4	カウンターパーティ信用リスク	49,234	84,961	4,083	7,001
5	うち、SA-CCR適用分	8,844	—	749	—
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	14,960	—	1,268
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,985	40,912	1,438	3,273
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,093	1,403	87	112
	その他	21,311	27,684	1,807	2,347
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	292,762	265,608	24,826	22,523
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)	293,257	220,881	23,460	17,670
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)	4,770	—	381	—
	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%)	14,525	26,629	1,231	2,258
	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%)	24,086	68,241	2,042	5,786
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%)	785,919	833,673	62,873	66,693
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	36,655	30,652	2,932	2,452
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	36,655	30,652	2,932	2,452
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	156,360	154,923	12,508	12,393
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	156,360	154,923	12,508	12,393
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	4,252,572	4,144,232	354,252	345,123

(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。