

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6月期)	前四半期末 (2023年3月期)	当四半期末 (2023年6月期)	前四半期末 (2023年3月期)
1	信用リスク	3,240,761	2,661,894	272,424	225,503
2	うち、標準的手法適用分	440,579	5,721	35,246	457
3	うち、内部格付手法適用分	2,742,476	2,614,942	232,561	221,747
	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	3,710	3,722	296	297
	その他	53,994	37,508	4,319	3,000
4	カウンターパーティ信用リスク	58,870	49,234	4,878	4,083
5	うち、SA-CCR適用分	9,674	8,844	818	749
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	20,564	17,985	1,645	1,438
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,234	1,093	98	87
	その他	27,397	21,311	2,315	1,807
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	300,843	276,072	25,511	23,410
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)	149,778	193,117	11,982	15,449
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)	4,783	4,770	382	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%)	38,551	14,530	3,269	1,232
	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%)	39,520	24,189	3,351	2,051
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%)	948,146	788,588	75,851	63,087
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	36,902	36,655	2,952	2,932
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	36,902	36,655	2,952	2,932
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	183,496	183,790	14,679	14,703
20	うち、基礎的手法適用分	183,496	—	14,679	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	183,790	—	14,703
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	5,002,215	4,233,403	415,331	352,882

(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6月期)	前四半期末 (2023年3月期)	当四半期末 (2023年6月期)	前四半期末 (2023年3月期)
1	信用リスク	2,727,291	2,594,997	231,091	219,911
2	うち、標準的手法適用分	6,659	2,587	532	207
3	うち、内部格付手法適用分	2,689,102	2,564,873	228,035	217,501
	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	31,530	27,536	2,522	2,202
4	カウンターパーティ信用リスク	54,870	49,234	4,558	4,083
5	うち、SA-CCR適用分	9,255	8,844	784	749
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,531	17,985	1,482	1,438
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,234	1,093	98	87
	その他	25,849	21,311	2,192	1,807
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	298,150	292,762	25,283	24,826
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)	216,424	293,257	17,313	23,460
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)	4,783	4,770	382	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%)	38,487	14,525	3,263	1,231
	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%)	39,511	24,086	3,350	2,042
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%)	946,220	785,919	75,697	62,873
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	36,902	36,655	2,952	2,932
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	36,902	36,655	2,952	2,932
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	155,209	156,360	12,416	12,508
20	うち、基礎的手法適用分	155,209	—	12,416	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	156,360	—	12,508
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	4,517,851	4,252,572	376,309	354,252

(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。