

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12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)		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12月期)	前四半期末 (2023年9月期)	当四半期末 (2023年12月期)	前四半期末 (2023年9月期)
1	信用リスク	3,251,045	3,159,534	273,376	265,555
2	うち、標準的手法適用分	431,161	437,171	34,492	34,973
3	うち、内部格付手法適用分	2,769,290	2,665,188	234,835	226,008
	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	3,708	3,692	296	295
	その他	46,885	53,481	3,750	4,278
4	カウンターパーティ信用リスク	57,028	53,227	4,731	4,407
5	うち、SA-CCR適用分	8,867	8,576	750	725
	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	18,422	18,888	1,473	1,511
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,578	1,347	126	107
	その他	28,160	24,415	2,380	2,063
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	306,177	327,783	25,963	27,796
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)	134,646	155,154	10,771	12,412
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)	108,717	106,428	8,697	8,514
	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%)	20,336	19,698	1,724	1,670
	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%)	18,622	22,859	1,579	1,938
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%)	759,866	760,713	60,789	60,857
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	37,734	37,076	3,018	2,966
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	37,734	37,076	3,018	2,966
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	208,524	208,524	16,681	16,681
20	うち、基礎的手法適用分	208,524	208,524	16,681	16,681
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—
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	4,903,260	4,851,560	407,381	402,847

(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12月期)	前四半期末 (2023年9月期)	当四半期末 (2023年12月期)	前四半期末 (2023年9月期)
1	信用リスク	2,749,027	2,654,998	232,961	224,945
2	うち、標準的手法適用分	3,788	5,442	303	435
3	うち、内部格付手法適用分	2,716,598	2,613,763	230,367	221,647
	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	28,640	35,792	2,291	2,863
4	カウンターパーティ信用リスク	53,955	49,924	4,485	4,143
5	うち、SA-CCR適用分	8,564	8,237	726	698
	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	17,151	17,414	1,372	1,393
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,578	1,347	126	107
	その他	26,661	22,925	2,260	1,944
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	301,410	323,595	25,559	27,440
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)	217,825	222,807	17,426	17,824
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)	108,717	106,428	8,697	8,514
	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%)	20,235	19,633	1,715	1,664
	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%)	18,622	22,855	1,579	1,938
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%)	745,513	758,552	59,641	60,684
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	37,734	37,076	3,018	2,966
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	37,734	37,076	3,018	2,966
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	156,274	156,274	12,501	12,501
20	うち、基礎的手法適用分	156,274	156,274	12,501	12,501
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—
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	4,409,317	4,352,146	367,587	362,624

(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。