

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
(2024年3月期自己資本比率)

(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		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	信用リスク	3,305,172		264,413	
2	うち、標準的手法適用分	409,813		32,785	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,801,159		224,092	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	44,516		3,561	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	—		—	
	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	3,688		295	
	その他	45,994		3,679	
6	カウンターパーティ信用リスク	41,881		3,350	
7	うち、SA-CCR適用分	5,438		435	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,382		110	
9	その他	35,061		2,804	
10	CVAリスク	15,557		1,244	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	—		—	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	15,557		1,244	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	352,547		28,203	
12	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)	172,387		13,791	
13	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 (マデント方式)	129,780		10,382	
	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%)	13,912		1,113	
	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%)	17,971		1,437	
14	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%)	573,442		45,875	
15	未決済取引	—		—	
16	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	43,033		3,442	
17	うち、内部格付手法準拠方式	—		—	
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	43,033		3,442	
19	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	—		—	
20	マーケット・リスク	—		—	
21	うち、標準的方式適用分	—		—	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	—		—	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	206,114		16,489	
25	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		44	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	4,872,362		389,789	

(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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	信用リスク		3,251,045		273,376
2	うち、標準的手法適用分		431,161		34,492
3	うち、内部格付手法適用分		2,769,290		234,835
	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		296
	その他		46,885		3,750
4	カウンターパーティ信用リスク		57,028		4,731
5	うち、SA-CCR適用分		8,867		750
	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		1,473
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		1,578		126
	その他		28,160		2,380
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		25,963
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		10,771
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		8,697
	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		1,724
	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		1,579
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		60,789
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		3,018
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		3,018
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		16,681
20	うち、基礎的手法適用分		208,524		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		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		407,381

(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)

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	
		当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	信用リスク	2,822,286		225,782	
2	うち、標準的手法適用分	1,704		136	
3	うち、基礎的的内部格付手法適用分	2,747,989		219,839	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	44,516		3,561	
5	うち、先進的的内部格付手法適用分	—		—	
	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	28,075		2,246	
6	カウンターパーティ信用リスク	41,510		3,320	
7	うち、SA-CCR適用分	5,436		434	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,382		110	
9	その他	34,691		2,775	
10	CVAリスク	15,557		1,244	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	—		—	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	15,557		1,244	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	345,579		27,646	
12	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)	225,235		18,018	
13	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 (マンドレート方式)	129,780		10,382	
	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%)	13,872		1,109	
	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%)	17,971		1,437	
14	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%)	562,704		45,016	
15	未決済取引	—		—	
16	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	43,033		3,442	
17	うち、内部格付手法準拠方式	—		—	
18	うち、外部格付準拠方式適用分又は内部評価方式適用分	43,033		3,442	
19	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	—		—	
20	マーケット・リスク	—		—	
21	うち、標準的方式適用分	—		—	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	—		—	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	171,712		13,737	
25	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	—		—	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	4,389,243		351,139	

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 (単体)					
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	
		当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)	当四半期末 (2024年3月期)	前四半期末 (2023年12月期)
1	信用リスク		2,749,027		232,961
2	うち、標準的手法適用分		3,788		303
3	うち、内部格付手法適用分		2,716,598		230,367
	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		2,291
4	カウンターパーティ信用リスク		53,955		4,485
5	うち、SA-CCR適用分		8,564		726
	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		1,372
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		1,578		126
	その他		26,661		2,260
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		25,559
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		17,426
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		8,697
	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		1,715
	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		1,579
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		59,641
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		3,018
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		3,018
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		12,501
20	うち、基礎的手法適用分		156,274		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		367,587