

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6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)					
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6月期)	前四半期末 (2024年3月期)	当四半期末 (2024年6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
1	信用リスク	3,307,033	3,305,172	264,562	264,413
2	うち、標準的手法適用分	401,919	409,813	32,153	32,785
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,785,432	2,801,159	222,834	224,092
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	57,010	44,516	4,560	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	3,704	3,688	296	295
	その他	58,967	45,994	4,717	3,679
6	カウンターパーティ信用リスク	45,597	41,881	3,647	3,350
7	うち、SA-CCR適用分	11,054	5,438	884	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	1,398	1,382	111	110
9	その他	33,143	35,061	2,651	2,804
10	CVAリスク	19,937	15,557	1,595	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	19,937	15,557	1,595	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	357,178	352,547	28,574	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)	182,752	172,387	14,620	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(マンドート方式)	161,139	129,780	12,891	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%)	10,673	13,912	853	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%)	21,137	17,971	1,691	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%)	587,446	573,442	46,995	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	44,866	43,033	3,589	3,442
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	—	—	—	—
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	44,866	43,033	3,589	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	206,114	16,489	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	560	44	44
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	4,944,438	4,872,362	395,555	389,789

(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6月期)	前四半期末 (2024年3月期)	当四半期末 (2024年6月期)	前四半期末 (2024年3月期)
1	信用リスク	2,836,523	2,822,286	226,921	225,782
2	うち、標準的手法適用分	3,637	1,704	290	136
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,735,469	2,747,989	218,837	219,839
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	57,010	44,516	4,560	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	—	—	—	—
	その他	40,406	28,075	3,232	2,246
6	カウンターパーティ信用リスク	45,242	41,510	3,619	3,320
7	うち、SA-CCR適用分	11,050	5,436	884	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	1,398	1,382	111	110
9	その他	32,793	34,691	2,623	2,775
10	CVAリスク	19,937	15,557	1,595	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	19,937	15,557	1,595	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	350,028	345,579	28,002	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)	242,012	225,235	19,361	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 (マンドート方式)	161,139	129,780	12,891	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%)	10,633	13,872	850	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%)	21,137	17,971	1,691	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%)	577,533	562,704	46,202	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	44,866	43,033	3,589	3,442
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	—	—	—	—
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	44,866	43,033	3,589	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	171,712	13,737	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	4,480,768	4,389,243	358,461	351,139