

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9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9月期)	前四半期末 (2024年6月期)	当四半期末 (2024年9月期)	前四半期末 (2024年6月期)
1	信用リスク	3,265,077	3,307,033	261,206	264,562
2	うち、標準的手法適用分	376,398	401,919	30,111	32,153
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,772,601	2,785,432	221,808	222,834
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	58,211	57,010	4,656	4,560
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	3,719	3,704	297	296
	その他	54,147	58,967	4,331	4,717
6	カウンターパーティ信用リスク	43,268	45,597	3,461	3,647
7	うち、SA-CCR適用分	10,808	11,054	864	884
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	1,589	1,398	127	111
9	その他	30,869	33,143	2,469	2,651
10	CVAリスク	24,210	19,937	1,936	1,595
	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	24,210	19,937	1,936	1,595
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	317,495	357,178	25,399	28,574
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)	147,249	182,752	11,779	14,620
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 (マデット方式)	159,463	161,139	12,757	12,891
	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%)	8,218	10,673	657	853
	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%)	16,391	21,137	1,311	1,691
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%)	531,963	587,446	42,557	46,995
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	47,424	44,866	3,793	3,589
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	47,424	44,866	3,793	3,589
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	228,316	206,114	18,265	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	4,789,637	4,944,438	383,171	395,555

(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9月期)	前四半期末 (2024年6月期)	当四半期末 (2024年9月期)	前四半期末 (2024年6月期)
1	信用リスク	2,834,956	2,836,523	226,796	226,921
2	うち、標準的手法適用分	1,112	3,637	89	290
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,739,426	2,735,469	219,154	218,837
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	58,211	57,010	4,656	4,560
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	36,206	40,406	2,896	3,232
6	カウンターパーティ信用リスク	42,911	45,242	3,432	3,619
7	うち、SA-CCR適用分	10,808	11,050	864	884
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	1,589	1,398	127	111
9	その他	30,512	32,793	2,441	2,623
10	CVAリスク	24,210	19,937	1,936	1,595
	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	24,210	19,937	1,936	1,595
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	324,539	350,028	25,963	28,002
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)	214,852	242,012	17,188	19,361
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 (マンドेट方式)	159,463	161,139	12,757	12,891
	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%)	8,178	10,633	654	850
	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%)	16,391	21,137	1,311	1,691
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%)	521,929	577,533	41,754	46,202
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	47,424	44,866	3,793	3,589
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	47,424	44,866	3,793	3,589
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	194,355	171,712	15,548	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	4,389,213	4,480,768	351,137	358,461