

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12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12月期) | 前四半期末 (2024年9月期) | 当四半期末 (2024年12月期) | 前四半期末 (2024年9月期) |
| 1 | 信用リスク | 3,568,317 | 3,265,077 | 285,465 | 261,206 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 352,533 | 376,398 | 28,202 | 30,111 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 3,097,575 | 2,772,601 | 247,806 | 221,808 |
| 4 | うち、スロットティング・クライテリア適用分 | 66,223 | 58,211 | 5,297 | 4,656 |
| 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 | 3,755 | 3,719 | 300 | 297 |
| | その他 | 48,229 | 54,147 | 3,858 | 4,331 |
| 6 | カウンターパーティ信用リスク | 41,585 | 43,268 | 3,326 | 3,461 |
| 7 | うち、SA-CCR適用分 | 10,191 | 10,808 | 815 | 864 |
| 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 | 1,427 | 1,589 | 114 | 127 |
| 9 | その他 | 29,965 | 30,869 | 2,397 | 2,469 |
| 10 | CVAリスク | 20,986 | 24,210 | 1,678 | 1,936 |
| | 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 | 20,986 | 24,210 | 1,678 | 1,936 |
| 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 | 302,420 | 317,495 | 24,193 | 25,399 |
| 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) | 143,882 | 147,249 | 11,510 | 11,779 |
| 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) | 186,930 | 159,463 | 14,954 | 12,757 |
| | 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%) | 8,491 | 8,218 | 679 | 657 |
| | 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%) | 21,091 | 16,391 | 1,687 | 1,311 |
| 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%) | 574,900 | 531,963 | 45,992 | 42,557 |
| 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 | 49,446 | 47,424 | 3,955 | 3,793 |
| 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 | 49,446 | 47,424 | 3,955 | 3,793 |
| 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 | 228,316 | 18,265 | 18,265 |
| 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 | 5,146,929 | 4,789,637 | 411,754 | 383,171 |

(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12月期) | 前四半期末 (2024年9月期) | 当四半期末 (2024年12月期) | 前四半期末 (2024年9月期) |
| 1 | 信用リスク | 3,175,487 | 2,834,956 | 254,038 | 226,796 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 5,026 | 1,112 | 402 | 89 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 3,074,660 | 2,739,426 | 245,972 | 219,154 |
| 4 | うち、スロットティング・クライテリア適用分 | 66,223 | 58,211 | 5,297 | 4,656 |
| 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 | 29,577 | 36,206 | 2,366 | 2,896 |
| 6 | カウンターパーティ信用リスク | 41,235 | 42,911 | 3,298 | 3,432 |
| 7 | うち、SA-CCR適用分 | 10,185 | 10,808 | 814 | 864 |
| 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 | 1,427 | 1,589 | 114 | 127 |
| 9 | その他 | 29,623 | 30,512 | 2,369 | 2,441 |
| 10 | CVAリスク | 20,986 | 24,210 | 1,678 | 1,936 |
| | 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 | 20,986 | 24,210 | 1,678 | 1,936 |
| 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 | 316,698 | 324,539 | 25,335 | 25,963 |
| 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) | 212,401 | 214,852 | 16,992 | 17,188 |
| 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) | 186,930 | 159,463 | 14,954 | 12,757 |
| | 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%) | 8,441 | 8,178 | 675 | 654 |
| | 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%) | 21,091 | 16,391 | 1,687 | 1,311 |
| 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%) | 571,350 | 521,929 | 45,708 | 41,754 |
| 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 | 49,446 | 47,424 | 3,955 | 3,793 |
| 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 | 49,446 | 47,424 | 3,955 | 3,793 |
| 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 | 194,355 | 15,548 | 15,548 |
| 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 | 4,798,425 | 4,389,213 | 383,874 | 351,137 |