

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結：2022年9月末】(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					
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	
		2022年9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	2,740,978	2,741,491	232,047	232,089
2	うち、標準的手法適用分	35,408	35,458	2,832	2,836
3	うち、内部格付手法適用分	2,660,205	2,660,492	225,585	225,609
	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	45,364	45,540	3,629	3,643
4	カウンターパーティ信用リスク	73,668	72,850	6,017	5,954
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	22,814	21,901	1,934	1,857
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	45,327	43,990	3,626	3,519
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,419	2,551	193	204
	その他	3,106	4,406	263	373
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	377,239	381,130	31,989	32,319
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)	285,071	299,887	24,174	25,430
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)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
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%)	241	244	19	19
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	131,700	124,964	10,536	9,997
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	131,700	124,964	10,536	9,997
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	161,147	155,802	12,891	12,464
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	161,147	155,802	12,891	12,464
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	50,675	37,719	4,292	3,193
	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	3,820,723	3,814,091	321,968	321,468

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結:2022年9月末】(別紙様式第八号第二面)

(単位:百万円)

CR8: 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表		
項番		信用リスク・アセットの額
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,112,727
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模
3		ポートフォリオの質
4		モデルの更新
5		手法及び方針
6		買収又は売却
7		為替の変動
8		その他
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,121,151

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【単体：2022年9月末】(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					
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	
		2022年 9月末	2022年 6月末	2022年 9月末	2022年 6月末
1	信用リスク	2,720,208	2,721,863	230,489	230,629
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,681,892	2,683,470	227,424	227,558
	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	38,316	38,393	3,065	3,071
4	カウンターパーティ信用リスク	73,710	72,850	6,021	5,954
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	22,842	21,901	1,937	1,857
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	45,342	43,990	3,627	3,519
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,419	2,551	193	204
	その他	3,106	4,406	263	373
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	377,199	381,090	31,986	32,316
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)	284,139	298,938	24,095	25,349
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)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
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%)	-	-	-	-
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	131,700	124,964	10,536	9,997
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	131,700	124,964	10,536	9,997
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	151,943	146,720	12,155	11,737
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	151,943	146,720	12,155	11,737
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	44,162	31,015	3,744	2,630
	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	3,783,064	3,777,444	319,029	318,615