

連結自己資本規制および連結流動性規制に関する開示の訂正について

過去に公表いたしました連結自己資本規制および連結流動性規制に関する開示に誤りがありました。主に期待エクスポージャー方式適用分におけるカウンターパーティ信用リスクが過少に計上されておりました。お詫び申し上げますとともに、下記の通り訂正いたします。

【2023年9月末】

第1部 連結自己資本規制に関する開示

第1章 自己資本の構成に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
12	適格引当金不足額	<u>45,948</u>	<u>38,836</u>	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	<u>282,216</u>	<u>290,835</u>	
普通株式等Tier1 資本				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	<u>3,005,818</u>	<u>2,971,114</u>	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	<u>3,382,512</u>	<u>3,347,031</u>	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	<u>3,382,910</u>	<u>3,347,388</u>	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>18,160,120</u>	<u>17,813,560</u>	
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>16.55%</u>	<u>16.67%</u>	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>18.62%</u>	<u>18.78%</u>	

63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>18.62%</u>	<u>18.79%</u>	
68	連結資本バッファー比率	<u>10.62%</u>	<u>10.79%</u>	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2023年9月末	2023年6月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
12	適格引当金不足額	46,018	38,857	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	282,287	290,856	
普通株式等Tier1 資本				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	3,005,748	2,971,093	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	3,382,441	3,347,011	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	3,382,840	3,347,368	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	18,212,210	17,833,741	
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	16.50%	16.65%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	18.57%	18.76%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	18.57%	18.76%	
68	連結資本バッファ比率	10.57%	10.76%	

第3章 定量的な開示事項

(1) 主要な指標

KM1：主要な指標

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>3,005,818</u>	<u>2,971,114</u>	2,828,797	2,871,061	2,906,132
2	Tier1資本の額	<u>3,382,512</u>	<u>3,347,031</u>	3,203,714	3,247,793	3,282,893
3	総自己資本の額	<u>3,382,910</u>	<u>3,347,388</u>	3,204,118	3,248,223	3,283,331
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>18,160,120</u>	<u>17,813,560</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>16.55%</u>	<u>16.67%</u>	16.32%	16.00%	16.92%
6	連結Tier1比率	<u>18.62%</u>	<u>18.78%</u>	18.49%	18.10%	19.12%
7	連結総自己資本比率	<u>18.62%</u>	<u>18.79%</u>	18.49%	18.11%	19.12%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>10.62%</u>	<u>10.79%</u>	10.49%	10.11%	11.12%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>65,284,039</u>	<u>61,835,129</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2024年3月期 第2四半期	2024年3月期 第1四半期	2023年3月期 第4四半期	2023年3月期 第3四半期	2023年3月期 第2四半期
連結安定調達比率						
19	所要安定調達額	<u>15,564,188</u>	<u>14,646,889</u>	13,317,821	12,602,939	13,893,170

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	3,005,748	2,971,093	2,828,797	2,871,061	2,906,132
2	Tier1資本の額	3,382,441	3,347,011	3,203,714	3,247,793	3,282,893
3	総自己資本の額	3,382,840	3,347,368	3,204,118	3,248,223	3,283,331
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	18,212,210	17,833,741	17,323,921	17,934,115	17,169,832
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	16.50%	16.65%	16.32%	16.00%	16.92%
6	連結Tier1比率	18.57%	18.76%	18.49%	18.10%	19.12%
7	連結総自己資本比率	18.57%	18.76%	18.49%	18.11%	19.12%
資本バッファ						
12	連結資本バッファ比率	10.57%	10.76%	10.49%	10.11%	11.12%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	65,283,968	61,835,108	56,865,053	58,706,412	60,577,625

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2024年3月期第2四半期	2024年3月期第1四半期	2023年3月期第4四半期	2023年3月期第3四半期	2023年3月期第2四半期
連結安定調達比率						
19	所要安定調達額	15,564,259	14,646,910	13,317,821	12,602,939	13,893,170

KM2：主要な指標

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM2：主要な指標 (TLAC要件)						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
資本						
1	外部TLACの額	6,755,244	6,401,703	6,046,709	5,880,071	6,087,591
2	リスク・アセットの額	18,160,120	17,813,560	17,323,921	17,934,115	17,169,832

3	資本バッファ案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>37.19%</u>	<u>35.93%</u>	34.90%	32.78%	35.45%
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>33.94%</u>	<u>32.80%</u>	31.78%	29.67%	32.44%
4	総エクスポージャーの額	<u>65,284,039</u>	<u>61,835,129</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM2：主要な指標（TLAC要件）						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末
資本						
1	外部TLACの額	<u>6,756,476</u>	<u>6,402,186</u>	6,046,709	5,880,071	6,087,591
2	リスク・アセットの額	<u>18,212,210</u>	<u>17,833,741</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832
3	資本バッファ案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>37.09%</u>	<u>35.89%</u>	34.90%	32.78%	35.45%
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>33.84%</u>	<u>32.76%</u>	31.78%	29.67%	32.44%
4	総エクスポージャーの額	<u>65,283,968</u>	<u>61,835,108</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

<訂正前>

(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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,594,287</u>	<u>3,558,309</u>	<u>297,263</u>	<u>293,975</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,037,207</u>	<u>1,040,078</u>	<u>87,955</u>	<u>88,198</u>
	うち、CVAリスク	<u>1,122,076</u>	<u>1,134,003</u>	<u>89,766</u>	<u>90,720</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>421,821</u>	<u>439,430</u>	<u>33,745</u>	<u>35,154</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>18,160,120</u>	<u>17,813,560</u>	<u>1,452,809</u>	<u>1,425,084</u>

<訂正後>

(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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,644,339</u>	<u>3,577,706</u>	<u>301,430</u>	<u>295,589</u>
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,071,166</u>	<u>1,053,146</u>	<u>90,834</u>	<u>89,306</u>
	うち、CVAリスク	<u>1,127,076</u>	<u>1,134,003</u>	<u>90,166</u>	<u>90,720</u>
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>432,914</u>	<u>445,759</u>	<u>34,633</u>	<u>35,660</u>
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>18,212,210</u>	<u>17,833,741</u>	<u>1,456,976</u>	<u>1,426,699</u>

(4) カウンターパーティー信用リスクに関する事項

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャーの額

<訂正前>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
2	期待エクスポージャー方式			3,987,647	1.4	5,701,194	1,037,207
6	合計						2,050,389

<訂正後>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 1 : 手法別のカウンターパーティー信用リスク・エクスポージャー額							
項番		イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		RC	PFE	実効EPE	規制上のエクスポージャーの算定に使用される α	信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額
2	期待エクスポージャー方式			4,107,057	1.4	5,868,369	1,071,166
6	合計						2,084,348

CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課

<訂正前>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	2,884,398	739,534
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		244,238
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		495,296
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,825,834	1,122,076

<訂正後>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 2 : CVA リスクに対する資本賦課			
項番		イ	ロ
		信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー	リスク・アセットの額 (CVAリスク相当額を8%で除して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	3,051,573	744,534
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		245,889
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額 (乗数適用後)		498,644
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	3,993,009	1,127,076

CCR 4 : 内部格付手法 - ポートフォリオ別及びPD 区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

<訂正前>

2023年9月末

(単位: 百万円、%、千件、年)

CCR 4 : 内部格付手法 - ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	ロ 平均PD	ハ 取引相手方の 数	ニ 平均LGD	ホ 平均残存期間	ヘ 信用リスク・ アセット	ト リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,779,379	0.01%	0.1	43.66%	0.7	41,748	2.34%
9	小計	1,804,626	0.02%	0.1	43.68%	0.7	51,914	2.87%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	5,020,643	0.05%	0.3	23.81%	0.6	378,281	7.53%
2	0.15以上0.25未満	212,563	0.18%	100件未満	33.71%	1.0	58,500	27.52%
3	0.25以上0.50未満	259,505	0.30%	0.1	20.30%	1.1	53,637	20.66%
6	2.50以上10.00未満	128,162	7.38%	100件未満	4.79%	2.3	21,160	16.51%
9	小計	5,891,694	0.33%	0.8	23.20%	0.7	594,064	10.08%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	3,620,808	0.05%	5.8	30.89%	0.6	367,008	10.13%
2	0.15以上0.25未満	336,855	0.18%	0.6	44.51%	1.0	115,019	34.14%
3	0.25以上0.50未満	934,527	0.34%	0.4	13.68%	0.3	138,746	14.84%
4	0.50以上0.75未満	1,815,140	0.55%	0.2	3.38%	0.0	91,792	5.05%
5	0.75以上2.50未満	400,483	1.08%	0.3	21.82%	0.6	177,636	44.35%
6	2.50以上10.00未満	209,630	6.54%	0.3	25.06%	0.4	183,605	87.58%
7	10.00以上100.00未満	261,056	26.31%	1.4	20.27%	0.5	305,238	116.92%
9	小計	7,583,843	1.42%	9.3	21.79%	0.5	1,379,046	18.18%
合計 (全てのポートフォリオ)		15,280,163	0.83%	10.3	24.92%	0.6	2,025,026	13.25%

<訂正後>

2023年9月末

(単位：百万円、%、千件、年)

CCR 4：内部格付手法－ポートフォリオ別及びPD区分別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー								
項番	PD区分	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ	ト
		EAD (信用リスク 削減効果勘案 後)	平均PD	取引相手方の 数	平均LGD	平均残存期間	信用リスク・ アセット	リスク・ウェ イトの加重平 均値 (RWA density)
ソブリン向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	1,778,237	0.01%	0.1	43.66%	0.7	41,632	2.34%
9	小計	1,803,484	0.02%	0.1	43.68%	0.7	51,798	2.87%
金融機関等向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	5,167,034	0.05%	0.3	24.41%	0.6	400,997	7.76%
2	0.15以上0.25未満	218,801	0.18%	100件未満	34.03%	1.0	60,850	27.81%
3	0.25以上0.50未満	259,508	0.30%	0.1	20.30%	1.1	53,638	20.66%
6	2.50以上10.00未満	128,165	7.38%	100件未満	4.79%	2.3	21,164	16.51%
9	小計	6,044,329	0.32%	0.8	23.75%	0.7	619,135	10.24%
事業法人向けエクスポージャー								
1	0.00以上0.15未満	3,622,117	0.05%	5.8	30.89%	0.6	367,145	10.13%
2	0.15以上0.25未満	338,056	0.18%	0.6	44.51%	1.0	115,469	34.15%
3	0.25以上0.50未満	939,490	0.34%	0.4	13.84%	0.3	141,053	15.01%
4	0.50以上0.75未満	1,822,907	0.55%	0.2	3.56%	0.0	97,389	5.34%
5	0.75以上2.50未満	400,884	1.08%	0.3	21.84%	0.6	178,081	44.42%
6	2.50以上10.00未満	209,670	6.54%	0.3	25.07%	0.4	183,670	87.59%
7	10.00以上100.00未満	261,057	26.31%	1.4	20.27%	0.5	305,242	116.92%
9	小計	7,599,524	1.42%	9.3	21.84%	0.5	1,388,051	18.26%
合計 (全てのポートフォリオ)		15,447,338	0.82%	10.3	25.14%	0.6	2,058,985	13.32%

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセットの変動表

<訂正前>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・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（2023年6月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,040,078</u>
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 <u>△13,359</u>
3		取引相手方の信用力 <u>△14,698</u>
7		為替の変動 <u>25,187</u>
9	当四半期末時点（2023年9月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,037,207</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

CCR 7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・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（2023年6月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,053,146</u>
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 <u>6,504</u>
3		取引相手方の信用力 <u>△14,723</u>
7		為替の変動 <u>26,239</u>
9	当四半期末時点（2023年9月末）における信用リスク・アセットの額	<u>1,071,166</u>

CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー

<訂正前>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー (合計)		<u>211,192</u>
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	<u>4,991,118</u>	<u>99,822</u>
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	<u>3,567,020</u>	<u>71,340</u>

<訂正後>

2023年9月末

(単位：百万円)

CCR 8 : 中央清算機関向けエクスポージャー			
項番		イ	ロ
		中央清算機関向けエクスポージャー (信用リスク削減手法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー (合計)		<u>222,285</u>
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	<u>5,545,766</u>	<u>110,915</u>
3	(i) 派生商品取引 (上場以外)	<u>4,121,668</u>	<u>82,433</u>

(8) マクロプルーデンス監督措置に関する事項

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

<訂正前>

(単位：百万円,%)

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
ルクセンブルク	0.50%	124.099		
英国	2.00%	715.086		
小計		1,007.997		
合計		6,414.803	0.25%	1,930.101

<訂正後>

(単位：百万円,%)

CCyB 1 : カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況				
	イ	ロ	ハ	ニ
国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
ルクセンブルク	0.50%	124.122		
英国	2.00%	725.348		
小計		1,018.282		
合計		6,426.078	0.25%	1,925.863

第6章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年9月末	2023年6月末	2022年9月末
オン・バランス資産の額(1)					
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>218,097</u>	<u>204,633</u>	142,701
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>28,849,883</u>	<u>28,958,248</u>	26,538,790
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額 (ホ)	<u>3,382,512</u>	<u>3,347,031</u>	3,282,893
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>65,284,039</u>	<u>61,835,129</u>	60,577,625
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)					
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>65,284,039</u>	<u>61,835,129</u>	60,577,625
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>67,079,168</u>	<u>63,817,413</u>	62,016,088

<訂正後>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年9月末	2023年6月末	2022年9月末
オン・バランス資産の額(1)					
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>218,167</u>	<u>204,654</u>	142,701
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>28,849,813</u>	<u>28,958,227</u>	26,538,790
連結レバレッジ比率(5)					
20		資本の額 (ホ)	<u>3,382,441</u>	<u>3,347,011</u>	3,282,893
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>65,283,968</u>	<u>61,835,108</u>	60,577,625
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)					
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>65,283,968</u>	<u>61,835,108</u>	60,577,625
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>67,079,098</u>	<u>63,817,393</u>	62,016,088

第7章 TLAC 規制

<訂正前>

(単位：百万円、%)

TLAC 1 : TLAC の構成			
国際様式 の該号 当番号	項目	イ	ロ
		2023年9月末	2022年9月末
自己資本比率規制上の外部 TLAC (2)			
1	普通株式等 Tier 1 資本の額 (イ)	3,005,818	2,906,132
11	自己資本比率規制上の外部 TLAC の額 ((イ) + (ホ) + (ヌ)) (ル)	3,380,818	3,281,032
自己資本比率規制外の外部 TLAC (3)			
16	資本再構築のための事前のコミットメント相当額 (ワ)	454,003	429,245
17	調整項目適用前の自己資本比率規制外の外部 TLAC の額 ((ヲ) + (ワ)) (カ)	3,381,152	2,806,623
自己資本比率規制外の外部 TLAC (調整項目) (4)			
18	外部 TLAC の額 (調整前) ((ル) + (カ)) (ヨ)	6,761,971	6,087,655
22	外部 TLAC の額 (調整後) ((ヨ) - (タ) - (レ) - (ソ)) (ツ)	6,755,244	6,087,591
リスク・アセットの額及び総エクスポージャー (5)			
23	リスク・アセットの額 (ネ)	18,160,120	17,169,832
24	総エクスポージャーの額 (ナ)	65,284,039	60,577,625
外部 TLAC 比率及び資本バッファ (6)			
25	資本バッファ勘案前のリスク・アセットベース外部 TLAC 比率 ((ツ) / (ネ))	37.19%	35.45%
25a	リスク・アセットベース外部 TLAC 比率	33.94%	32.44%
27	連結資本バッファ比率	10.62%	11.12%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーベース外部 TLAC 比率(7)			
	総エクスポージャーの額 (ナ)	65,284,039	60,577,625
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ナ')	67,079,168	62,016,088

<訂正後>

(単位：百万円、%)

TLAC 1 : TLAC の構成			
国際様式 の該号 当番号	項目	イ	ロ
		2023 年 9 月末	2022 年 9 月末
自己資本比率規制上の外部 TLAC (2)			
1	普通株式等 Tier 1 資本の額 (イ)	<u>3,005,748</u>	2,906,132
11	自己資本比率規制上の外部 TLAC の額 ((イ) + (ホ) + (ヌ)) (ル)	<u>3,380,748</u>	3,281,032
自己資本比率規制外の外部 TLAC (3)			
16	資本再構築のための事前のコミットメント相当額 (ワ)	<u>455,305</u>	429,245
17	調整項目適用前の自己資本比率規制外の外部 TLAC の額 ((ヲ) + (ワ)) (カ)	<u>3,382,454</u>	2,806,623
自己資本比率規制外の外部 TLAC (調整項目) (4)			
18	外部 TLAC の額 (調整前) ((ル) + (カ)) (ヨ)	<u>6,763,203</u>	6,087,655
22	外部 TLAC の額 (調整後) ((ヨ) - (タ) - (レ) - (ソ)) (ツ)	<u>6,756,476</u>	6,087,591
リスク・アセットの額及び総エクスポージャー (5)			
23	リスク・アセットの額 (ネ)	<u>18,212,210</u>	17,169,832
24	総エクスポージャーの額 (ナ)	<u>65,283,968</u>	60,577,625
外部 TLAC 比率及び資本バッファ (6)			
25	資本バッファ勘案前のリスク・アセットベース外部 TLAC 比率 ((ツ) / (ネ))	<u>37.09%</u>	35.45%
25a	リスク・アセットベース外部 TLAC 比率	<u>33.84%</u>	32.44%
27	連結資本バッファ比率	<u>10.57%</u>	11.12%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーベース外部 TLAC 比率(7)			
	総エクスポージャーの額 (ナ)	<u>65,283,968</u>	60,577,625
	日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ナ')	<u>67,079,098</u>	62,016,088

第2部 連結流動性規制に関する開示

第3章 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

<訂正前>

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年9月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
26	その他の資産等	505,636	383,093	-	3,173,579	3,323,544	509,934	238,598	-	3,012,732	3,173,300
31	うち、上記に含まれない資産及び 資本の額	505,636	383,093	-	462,107	967,743	509,934	238,598	-	478,015	987,949
33	所要安定調達額合計					15,564,188					14,646,889

<訂正後>

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年9月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
26	その他の資産等	505,636	383,093	-	3,173,650	3,323,614	509,934	238,598	-	3,012,754	3,173,321
31	うち、上記に含まれない資産及び 資本の額	505,636	383,093	-	462,177	967,813	509,934	238,598	-	478,037	987,970
33	所要安定調達額合計					15,564,259					14,646,910

第4章 連結安定調達比率に関する定性的開示事項

<訂正前>

1. 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

会社グループの第2四半期連結会計期末の利用可能安定調達額合計は前四半期比7,300億48百万円増の17兆4,499億24百万円、所要安定調達額合計は同9,172億99百万円増の15兆5,641億88百万円となりました。ホールセール資金調達における利用可能安定調達額が同6,998億71百万円増の13兆387億28百万円、貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額における所要安定調達額が

同 7,827 億 76 百万円増の 9 兆 9,790 億 45 百万円、その他の資産等における所要安定調達額が同 1,502 億 44 百万円増の 3 兆 3,235 億 44 百万となりました。

この結果、会社グループの第 2 四半期連結会計期末における連結安定調達比率は、112.1%となりました。

会社グループの連結安定調達比率が変動する主な要因としては、無担保・有担保資金調達、顧客との有価証券売買取引に伴うトレーディング在庫、無担保貸出・有担保資金運用及びデリバティブ取引等におけるバランスシートの変化が挙げられます。

<訂正後>

1. 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

会社グループの第 2 四半期連結会計期末の利用可能安定調達額合計は前四半期比 7,300 億 48 百万円増の 17 兆 4,499 億 24 百万円、所要安定調達額合計は同 9,173 億 49 百万円増の 15 兆 5,642 億 59 百万円となりました。ホールセール資金調達における利用可能安定調達額が同 6,998 億 71 百万円増の 13 兆 387 億 28 百万円、貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額における所要安定調達額が同 7,827 億 76 百万円増の 9 兆 9,790 億 45 百万円、その他の資産等における所要安定調達額が同 1,502 億 93 百万円増の 3 兆 3,236 億 14 百万となりました。

この結果、会社グループの第 2 四半期連結会計期末における連結安定調達比率は、112.1%となりました。

会社グループの連結安定調達比率が変動する主な要因としては、無担保・有担保資金調達、顧客との有価証券売買取引に伴うトレーディング在庫、無担保貸出・有担保資金運用及びデリバティブ取引等におけるバランスシートの変化が挙げられます。

【2023年6月末】

第1部 連結自己資本規制に関する開示

第1章 自己資本の構成に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該当番号	項目	イ		ロ
		2023年6月末	2023年3月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
12	適格引当金不足額	38,836	38,970	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	290,835	316,487	
普通株式等Tier1 資本				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	2,971,114	2,828,797	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	3,347,031	3,203,714	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	3,347,388	3,204,118	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	17,813,560	17,323,921	
連結自己資本規制比率及び資本バッファー(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	16.67%	16.32%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	18.78%	18.49%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	18.79%	18.49%	
68	連結資本バッファー比率	10.79%	10.49%	

<訂正後>

(単位：百万円、%)

CC1：自己資本の構成				
国際様式の該 当番号	項目	イ		ロ
		2023年6月末	2023年3月末	別紙様式 第八号 (CC2)の 参照項目
普通株式等Tier1 資本に係る調整項目(2)				
12	適格引当金不足額	<u>38,857</u>	38,970	
28	普通株式等Tier1 資本に係る調整項目の額 (ロ)	<u>290,856</u>	316,487	
普通株式等Tier1 資本				
29	普通株式等Tier1 資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	<u>2,971,093</u>	2,828,797	
Tier1 資本				
45	Tier1 資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	<u>3,347,011</u>	3,203,714	
総自己資本				
59	総自己資本の合計((ト)+(ヌ)) (ル)	<u>3,347,368</u>	3,204,118	
リスク・アセット(6)				
60	リスク・アセットの額 (ヲ)	<u>17,833,741</u>	17,323,921	
連結自己資本規制比率及び資本バッファ(7)				
61	連結普通株式等Tier1 比率((ハ)/(ヲ))	<u>16.65%</u>	16.32%	
62	連結Tier1 比率((ト)/(ヲ))	<u>18.76%</u>	18.49%	
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	<u>18.76%</u>	18.49%	
68	連結資本バッファ比率	<u>10.76%</u>	10.49%	

第3章 定量的な開示事項

(1) 主要な指標

KM1：主要な資料

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末	2022年6月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,971,114</u>	2,828,797	2,871,061	2,906,132	2,822,591
2	Tier1資本の額	<u>3,347,031</u>	3,203,714	3,247,793	3,282,893	3,198,067
3	総自己資本の額	<u>3,347,388</u>	3,204,118	3,248,223	3,283,331	3,198,485
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>17,813,560</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832	16,893,081
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>16.67%</u>	16.32%	16.00%	16.92%	16.70%
6	連結Tier1比率	<u>18.78%</u>	18.49%	18.10%	19.12%	18.93%
7	連結総自己資本比率	<u>18.79%</u>	18.49%	18.11%	19.12%	18.93%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>10.79%</u>	10.49%	10.11%	11.12%	10.93%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>61,835,129</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625	57,903,731

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2024年3月期 第1四半期	2023年3月期 第4四半期	2023年3月期 第3四半期	2023年3月期 第2四半期	2023年3月期 第1四半期
連結安定調達比率						
19	所要安定調達額	<u>14,646,889</u>	13,317,821	12,602,939	13,893,170	13,030,889

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末	2022年6月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	<u>2,971,093</u>	2,828,797	2,871,061	2,906,132	2,822,591
2	Tier1資本の額	<u>3,347,011</u>	3,203,714	3,247,793	3,282,893	3,198,067
3	総自己資本の額	<u>3,347,368</u>	3,204,118	3,248,223	3,283,331	3,198,485
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	<u>17,833,741</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832	16,893,081
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	<u>16.65%</u>	16.32%	16.00%	16.92%	16.70%
6	連結Tier1比率	<u>18.76%</u>	18.49%	18.10%	19.12%	18.93%
7	連結総自己資本比率	<u>18.76%</u>	18.49%	18.11%	19.12%	18.93%
資本バッファー						
12	連結資本バッファー比率	<u>10.76%</u>	10.49%	10.11%	11.12%	10.93%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	<u>61,835,108</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625	57,903,731

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2024年3月期 第1四半期	2023年3月期 第4四半期	2023年3月期 第3四半期	2023年3月期 第2四半期	2023年3月期 第1四半期
連結安定調達比率						
19	所要安定調達額	<u>14,646,910</u>	13,317,821	12,602,939	13,893,170	13,030,889

KM2：主要な指標

<訂正前>

(単位：百万円、%)

KM2：主要な指標 (TLAC要件)						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末	2022年6月末
資本						
1	外部TLACの額	<u>6,401,703</u>	6,046,709	5,880,071	6,087,591	5,655,174

2	リスク・アセットの額	<u>17,813,560</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832	16,893,081
3	資本バッファー勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>35.93%</u>	34.90%	32.78%	35.45%	33.47%
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>32.80%</u>	31.78%	29.67%	32.44%	30.46%
4	総エクスポージャーの額	<u>61,835,129</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625	57,903,731

<訂正後>

(単位：百万円、%)

KM2：主要な指標（TLAC要件）						
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		2023年6月末	2023年3月末	2022年12月末	2022年9月末	2022年6月末
資本						
1	外部TLACの額	<u>6,402,186</u>	6,046,709	5,880,071	6,087,591	5,655,174
2	リスク・アセットの額	<u>17,833,741</u>	17,323,921	17,934,115	17,169,832	16,893,081
3	資本バッファー勘案前のリスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>35.89%</u>	34.90%	32.78%	35.45%	33.47%
3a	リスク・アセットベース外部TLAC比率	<u>32.76%</u>	31.78%	29.67%	32.44%	30.46%
4	総エクスポージャーの額	<u>61,835,108</u>	56,865,053	58,706,412	60,577,625	57,903,731

(2) リスク・アセットの概要

OV1：リスク・アセットの概要

<訂正前>

(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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,558,309</u>	3,272,265	<u>293,975</u>	270,849
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,040,078</u>	1,007,423	<u>88,198</u>	85,429
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>439,430</u>	358,497	<u>35,154</u>	28,679
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>17,813,560</u>	17,323,921	<u>1,425,084</u>	1,385,913

<訂正後>

(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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
4	カウンターパーティ信用リスク	<u>3,577,706</u>	3,272,265	<u>295,589</u>	270,849
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	<u>1,053,146</u>	1,007,423	<u>89,306</u>	85,429
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	<u>445,759</u>	358,497	<u>35,660</u>	28,679
25	合計(スケーリング・ファクター勘案後)	<u>17,833,741</u>	17,323,921	<u>1,426,699</u>	1,385,913

(3) リスク・アセットの変動表

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセットの変動表

<訂正前>

(単位：百万円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・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
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 <u>△30,738</u>
3		取引相手方の信用力 <u>△5,933</u>
7		為替の変動 <u>69,327</u>
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,040,078</u>

<訂正後>

(単位：百万円)

CCR7：期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・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
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 <u>△18,725</u>
3		取引相手方の信用力 <u>△6,028</u>
7		為替の変動 <u>70,477</u>
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	<u>1,053,146</u>

第5章 連結レバレッジ比率に関する開示事項

<訂正前>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年6月末	2023年3月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>204,633</u>	192,458
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>28,958,248</u>	25,495,082
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	<u>3,347,031</u>	3,203,714
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>61,835,129</u>	56,865,053
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>61,835,129</u>	56,865,053
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	<u>63,817,413</u>	58,834,276

<訂正後>

(単位：百万円、%)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2023年6月末	2023年3月末
オン・バランス資産の額(1)				
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額 (Δ)	<u>204,654</u>	192,458
3		オン・バランス資産の額 (イ)	<u>28,958,227</u>	25,495,082
連結レバレッジ比率(5)				
20		資本の額 (ホ)	<u>3,347,011</u>	3,203,714
21	8	総エクスポージャーの額 ((イ) + (ロ) + (ハ) + (ニ)) (ヘ)	<u>61,835,108</u>	56,865,053
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	<u>61,835,108</u>	56,865,053
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	<u>63,817,393</u>	58,834,276

第2部 連結流動性規制に関する開示

第2章 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

<訂正前>

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年3月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
26	その他の資産等	509,934	238,598	-	<u>3,012,732</u>	<u>3,173,300</u>	519,307	299,868	-	2,806,097	2,997,868
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	509,934	238,598	-	<u>478,015</u>	<u>987,949</u>	519,307	299,868	-	428,381	947,688
33	所要安定調達額合計					<u>14,646,889</u>					13,317,821

<訂正後>

項番		当最終指定親会社四半期末 (2023年6月末)					前最終指定親会社四半期末 (2023年3月末)				
		算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮 後金額
		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上 1年未満	1年以上	
26	その他の資産等	509,934	238,598	-	<u>3,012,754</u>	<u>3,173,321</u>	519,307	299,868	-	2,806,097	2,997,868
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	509,934	238,598	-	<u>478,037</u>	<u>987,970</u>	519,307	299,868	-	428,381	947,688
33	所要安定調達額合計					<u>14,646,910</u>					13,317,821

以上