

リスク・アセットの概要（2022年3月末・確定値）

【連結】

（単位：百万円）

OV1:リスク・アセットの概要		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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	5,048,019	4,983,843	427,142	421,666
2	うち、標準的手法適用分	66,275	72,529	5,302	5,802
3	うち、内部格付手法適用分	4,854,350	4,783,176	411,648	405,613
	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値のエクスポージャー	8,239	8,151	659	652
	その他	119,153	119,987	9,532	9,598
4	カウンターパーティ信用リスク	132,646	118,029	10,787	9,605
5	うち、SA-CCR適用分	35,678	32,695	3,025	2,772
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	95,435	83,851	7,634	6,708
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	594	294	47	23
	その他	937	1,188	79	100
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	265,272	254,873	22,495	21,613
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)	970,753	1,000,997	82,238	84,809
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 (マニフェスト方式)	75,849	61,473	6,067	4,917
	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%)	1,344	1,233	107	98
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	137,827	144,720	11,026	11,577
17	うち、標準的方式適用分	137,827	144,720	11,026	11,577
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	309,577	305,777	24,766	24,462
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	309,577	305,777	24,766	24,462
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	33,073	33,219	2,804	2,816
	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	1,112,958	1,168,097	89,036	93,447
25	合計	8,087,322	8,072,265	676,472	675,016

(注) 1. 「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。

## 【単体】

(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3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	4,993,814	4,926,154	422,796	417,045
2	うち、標準的手法適用分	22,639	24,797	1,811	1,983
3	うち、内部格付手法適用分	4,852,451	4,781,810	411,487	405,497
	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	118,724	119,546	9,497	9,563
4	カウンターパーティ信用リスク	132,646	118,029	10,787	9,605
5	うち、SA-CCR適用分	35,678	32,695	3,025	2,772
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	95,435	83,851	7,634	6,708
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	594	294	47	23
	その他	937	1,188	79	100
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	202,769	189,397	17,194	16,060
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)	970,753	1,000,997	82,238	84,809
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)	75,849	61,473	6,067	4,917
	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%)	1,344	1,233	107	98
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	136,587	143,009	10,926	11,440
17	うち、標準的方式適用分	136,587	143,009	10,926	11,440
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	291,297	287,525	23,303	23,002
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	291,297	287,525	23,303	23,002
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 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	11,687	12,249	991	1,038
24	フロア調整	1,001,558	1,062,268	80,124	84,981
25	合計	7,818,307	7,802,338	654,539	653,000

(注)1.「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2.内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。