

## リスク・アセットの概要（2022年6月末）

【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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	5,093,383	5,048,019	430,985	427,142
2	うち、標準的手法適用分	66,998	66,275	5,359	5,302
3	うち、内部格付手法適用分	4,898,883	4,854,350	415,425	411,648
	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	8,415	8,239	673	659
	その他	119,086	119,153	9,526	9,532
4	カウンターパーティ信用リスク	157,965	132,646	12,842	10,787
5	うち、SA-CCR適用分	41,765	35,678	3,541	3,025
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	114,258	95,435	9,140	7,634
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	849	594	67	47
	その他	1,091	937	92	79
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	267,891	265,272	22,717	22,495
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)	904,992	970,753	76,658	82,238
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)	89,530	75,849	7,162	6,067
	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%)	1,641	1,344	131	107
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	135,911	137,827	10,872	11,026
17	うち、標準的方式適用分	135,911	137,827	10,872	11,026
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	309,577	24,766	24,766
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	309,577	24,766	24,766
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	33,893	33,073	2,874	2,804
	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	1,190,129	1,112,958	95,210	89,036
25	合計	8,184,917	8,087,322	684,221	676,472

(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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	5,041,765	4,993,814	426,861	422,796
2	うち、標準的手法適用分	23,149	22,639	1,851	1,811
3	うち、内部格付手法適用分	4,899,962	4,852,451	415,516	411,487
	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	118,654	118,724	9,492	9,497
4	カウンターパーティ信用リスク	157,965	132,646	12,842	10,787
5	うち、SA-CCR適用分	41,765	35,678	3,541	3,025
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	114,258	95,435	9,140	7,634
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	849	594	67	47
	その他	1,091	937	92	79
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	204,367	202,769	17,330	17,194
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)	904,992	970,753	76,658	82,238
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)	89,530	75,849	7,162	6,067
	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%)	1,641	1,344	131	107
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	134,804	136,587	10,784	10,926
17	うち、標準的方式適用分	134,804	136,587	10,784	10,926
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	291,297	23,303	23,303
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	291,297	23,303	23,303
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	12,091	11,687	1,025	991
24	フロア調整	1,069,457	1,001,558	85,556	80,124
25	合計	7,907,914	7,818,307	661,656	654,539

(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。