

リスク・アセットの概要（2022年9月末・確定値）

【連結】

（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	5,097,145	5,093,383	431,276	430,985
2	うち、標準的手法適用分	74,743	66,998	5,979	5,359
3	うち、内部格付手法適用分	4,896,900	4,898,883	415,257	415,425
	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	8,622	8,415	689	673
	その他	116,878	119,086	9,350	9,526
4	カウンターパーティ信用リスク	142,225	157,965	11,559	12,842
5	うち、SA-CCR適用分	36,951	41,765	3,133	3,541
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	103,415	114,258	8,273	9,140
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,049	849	83	67
	その他	809	1,091	68	92
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	266,389	267,891	22,589	22,717
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)	914,401	904,992	77,446	76,658
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)	119,740	89,530	9,579	7,162
	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%)	2,349	1,641	187	131
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	147,805	135,911	11,824	10,872
17	うち、標準的方式適用分	147,805	135,911	11,824	10,872
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	316,730	309,577	25,338	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	316,730	309,577	25,338	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	33,768	33,893	2,863	2,874
	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	1,282,115	1,190,129	102,569	95,210
25	合計	8,322,672	8,184,917	695,235	684,221

(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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	5,054,144	5,041,765	427,883	426,861
2	うち、標準的手法適用分	31,108	23,149	2,488	1,851
3	うち、内部格付手法適用分	4,906,580	4,899,962	416,077	415,516
	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	116,455	118,654	9,316	9,492
4	カウンターパーティ信用リスク	142,225	157,965	11,559	12,842
5	うち、SA-CCR適用分	36,951	41,765	3,133	3,541
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	103,415	114,258	8,273	9,140
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,049	849	83	67
	その他	809	1,091	68	92
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	200,886	204,367	17,035	17,330
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)	914,401	904,992	77,446	76,658
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)	119,740	89,530	9,579	7,162
	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%)	2,349	1,641	187	131
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	146,527	134,804	11,722	10,784
17	うち、標準的方式適用分	146,527	134,804	11,722	10,784
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	299,641	291,297	23,971	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	299,641	291,297	23,971	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	11,751	12,091	996	1,025
24	フロア調整	1,156,989	1,069,457	92,559	85,556
25	合計	8,048,658	7,907,914	672,940	661,656

(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。