

リスク・アセットの概要（2022年12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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	5,124,334	5,097,145	433,568	431,276
2	うち、標準的手法適用分	77,042	74,743	6,163	5,979
3	うち、内部格付手法適用分	4,921,117	4,896,900	417,310	415,257
	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	8,839	8,622	707	689
	その他	117,335	116,878	9,386	9,350
4	カウンターパーティ信用リスク	138,215	142,225	11,230	11,559
5	うち、SA-CCR適用分	35,108	36,951	2,977	3,133
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	100,943	103,415	8,075	8,273
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,210	1,049	96	83
	その他	953	809	80	68
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	246,866	266,389	20,934	22,589
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)	890,434	914,401	75,362	77,446
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)	80,261	119,740	6,420	9,579
	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%)	14,795	2,349	1,183	187
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	148,287	147,805	11,862	11,824
17	うち、標準的方式適用分	148,287	147,805	11,862	11,824
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	316,730	25,338	25,338
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	316,730	25,338	25,338
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	35,901	33,768	3,044	2,863
	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	1,408,264	1,282,115	112,661	102,569
25	合計	8,404,092	8,322,672	701,606	695,235

(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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	5,076,090	5,054,144	429,755	427,883
2	うち、標準的手法適用分	28,299	31,108	2,263	2,488
3	うち、内部格付手法適用分	4,930,877	4,906,580	418,138	416,077
	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	116,913	116,455	9,353	9,316
4	カウンターパーティ信用リスク	138,215	142,225	11,230	11,559
5	うち、SA-CCR適用分	35,107	36,951	2,977	3,133
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	100,943	103,415	8,075	8,273
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,210	1,049	96	83
	その他	953	809	80	68
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	180,019	200,886	15,265	17,035
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)	890,434	914,401	75,362	77,446
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)	80,261	119,740	6,420	9,579
	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%)	14,795	2,349	1,183	187
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	147,405	146,527	11,792	11,722
17	うち、標準的方式適用分	147,405	146,527	11,792	11,722
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	299,641	23,971	23,971
20	うち、基本的な手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	299,641	299,641	23,971	23,971
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	13,811	11,751	1,171	986
24	フロア調整	1,284,361	1,156,989	102,748	92,559
25	合計	8,125,037	8,048,658	678,902	672,940

(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。