

リスク・アセットの概要（2023年3月末・速報値）

【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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	5,233,203	5,124,334	442,825	433,568
2	うち、標準的手法適用分	70,820	77,042	5,665	6,163
3	うち、内部格付手法適用分	5,035,332	4,921,117	426,996	417,310
	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	9,133	8,839	730	707
	その他	117,916	117,335	9,433	9,386
4	カウンターパーティ信用リスク	139,279	138,215	11,317	11,230
5	うち、SA-CCR適用分	35,467	35,108	3,007	2,977
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	101,498	100,943	8,119	8,075
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,213	1,210	97	96
	その他	1,099	953	93	80
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	265,943	246,866	22,552	20,934
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)	955,910	890,434	80,950	75,362
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)	69,539	80,261	5,563	6,420
	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%)	2,744	14,795	219	1,183
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	132,063	148,287	10,565	11,862
17	うち、標準的方式適用分	132,063	148,287	10,565	11,862
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	323,603	316,730	25,888	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	323,603	316,730	25,888	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	38,171	35,901	3,236	3,044
	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	1,159,683	1,408,264	92,774	112,661
25	合計	8,320,144	8,404,092	695,894	701,606

(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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	5,188,127	5,076,090	439,265	429,755
2	うち、標準的手法適用分	25,744	28,299	2,059	2,263
3	うち、内部格付手法適用分	5,044,883	4,930,877	427,806	418,138
	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	117,499	116,913	9,399	9,353
4	カウンターパーティ信用リスク	139,279	138,215	11,317	11,230
5	うち、SA-CCR適用分	35,467	35,107	3,007	2,977
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	101,498	100,943	8,119	8,075
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,213	1,210	97	96
	その他	1,099	953	93	80
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	196,967	180,019	16,702	15,265
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)	955,910	890,434	80,950	75,362
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)	69,539	80,261	5,563	6,420
	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%)	2,744	14,795	219	1,183
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	130,872	147,405	10,469	11,792
17	うち、標準的方式適用分	130,872	147,405	10,469	11,792
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	307,458	299,641	24,596	23,971
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	307,458	299,641	24,596	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	15,175	13,811	1,286	1,171
24	フロア調整	1,003,843	1,284,361	80,307	102,748
25	合計	8,009,919	8,125,037	670,680	678,902

(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。