

リスク・アセットの概要（2023年6月末）

【連結】

（単位：百万円）

| OVI: 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6月末 | 2023年3月末 | 2023年6月末 | 2023年3月末 |
| 1 | 信用リスク | 5,331,805 | 5,233,203 | 451,180 | 442,825 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 72,860 | 70,820 | 5,828 | 5,665 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 5,132,418 | 5,035,332 | 435,229 | 426,996 |
| | 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 | 9,312 | 9,133 | 744 | 730 |
| | その他 | 117,214 | 117,916 | 9,377 | 9,433 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 138,451 | 139,279 | 11,255 | 11,317 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | 35,904 | 35,467 | 3,044 | 3,007 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 99,820 | 101,498 | 7,985 | 8,119 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 1,297 | 1,213 | 103 | 97 |
| | その他 | 1,428 | 1,099 | 121 | 93 |
| 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 | 288,731 | 265,943 | 24,484 | 22,552 |
| 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) | 1,020,752 | 955,910 | 86,479 | 80,950 |
| 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) | 68,878 | 69,539 | 5,510 | 5,563 |
| | 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%) | 1,695 | 2,744 | 135 | 219 |
| 11 | 未決済取引 | 0 | - | 0 | - |
| 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 | 138,195 | 132,063 | 11,055 | 10,565 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 138,195 | 132,063 | 11,055 | 10,565 |
| 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 | 323,603 | 25,888 | 25,888 |
| 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 | 323,603 | 25,888 | 25,888 |
| 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 | 39,768 | 38,171 | 3,372 | 3,236 |
| | 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 | 1,120,375 | 1,159,683 | 89,630 | 92,774 |
| 25 | 合計 | 8,472,258 | 8,320,144 | 708,991 | 695,894 |

(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6月末 | 2023年3月末 | 2023年6月末 | 2023年3月末 |
| 1 | 信用リスク | 5,291,236 | 5,188,127 | 448,005 | 439,265 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 27,309 | 25,744 | 2,184 | 2,059 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 5,147,158 | 5,044,883 | 436,479 | 427,806 |
| | 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 | 116,768 | 117,499 | 9,341 | 9,399 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 138,451 | 139,279 | 11,255 | 11,317 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | 35,904 | 35,467 | 3,044 | 3,007 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 99,820 | 101,498 | 7,985 | 8,119 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 1,297 | 1,213 | 103 | 97 |
| | その他 | 1,428 | 1,099 | 121 | 93 |
| 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 | 209,185 | 196,967 | 17,738 | 16,702 |
| 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) | 1,020,752 | 955,910 | 86,479 | 80,950 |
| 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) | 68,878 | 69,539 | 5,510 | 5,563 |
| | 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%) | 1,695 | 2,744 | 135 | 219 |
| 11 | 未決済取引 | 0 | - | 0 | - |
| 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 | 136,424 | 130,872 | 10,913 | 10,469 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 136,424 | 130,872 | 10,913 | 10,469 |
| 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 | 307,458 | 24,596 | 24,596 |
| 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 | 307,458 | 24,596 | 24,596 |
| 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 | 16,443 | 15,175 | 1,394 | 1,286 |
| | 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 | 953,550 | 1,003,843 | 76,284 | 80,307 |
| 25 | 合計 | 8,144,077 | 8,009,919 | 682,313 | 670,680 |

(注)1.「国際様式の該当番号」とは、パ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。