

リスク・アセットの概要（2023年9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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	5,392,435	5,331,805	456,293	451,180
2	うち、標準的手法適用分	78,285	72,860	6,262	5,828
3	うち、内部格付手法適用分	5,187,148	5,132,418	439,870	435,229
	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	9,652	9,312	772	744
	その他	117,348	117,214	9,387	9,377
4	カウンターパーティ信用リスク	140,527	138,451	11,411	11,255
5	うち、SA-CCR適用分	32,694	35,904	2,772	3,044
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	103,751	99,820	8,300	7,985
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,517	1,297	121	103
	その他	2,564	1,428	217	121
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	307,603	288,731	26,084	24,484
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)	1,042,296	1,020,752	88,314	86,479
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)	121,293	68,878	9,703	5,510
	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%)	4,122	1,695	329	135
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	140,136	138,195	11,210	11,055
17	うち、標準的方式適用分	140,136	138,195	11,210	11,055
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	329,318	323,603	26,345	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	329,318	323,603	26,345	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	39,559	39,768	3,354	3,372
	終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	1,194,220	1,120,375	95,537	89,630
25	合計	8,711,514	8,472,258	728,585	708,991

(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。

【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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	5,349,605	5,291,236	452,951	448,005
2	うち、標準的手法適用分	27,900	27,309	2,232	2,184
3	うち、内部格付手法適用分	5,204,806	5,147,158	441,367	436,479
	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	116,898	116,768	9,351	9,341
4	カウンターパーティ信用リスク	140,527	138,451	11,411	11,255
5	うち、SA-CCR適用分	32,694	35,904	2,772	3,044
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	103,751	99,820	8,300	7,985
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,517	1,297	121	103
	その他	2,564	1,428	217	121
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	225,627	209,185	19,133	17,738
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)	1,042,296	1,020,752	88,314	86,479
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)	121,293	68,878	9,703	5,510
	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%)	4,122	1,695	329	135
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	138,788	136,424	11,103	10,913
17	うち、標準的方式適用分	138,788	136,424	11,103	10,913
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	314,634	307,458	25,170	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	314,634	307,458	25,170	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	16,184	16,443	1,372	1,394
	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	1,029,884	953,550	82,390	76,284
25	合計	8,382,966	8,144,077	701,880	682,313

(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。