

リスク・アセットの概要（2022年6月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	4, 513, 765	4, 486, 633	381, 462	379, 235
2	うち、標準的手法適用分	119, 120	120, 043	9, 529	9, 603
3	うち、内部格付手法適用分	4, 241, 898	4, 230, 107	359, 712	358, 713
	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	152, 746	136, 481	12, 219	10, 918
4	カウンターパーティ信用リスク	137, 378	122, 165	11, 182	9, 949
5	うち、S A－C C R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	39, 488	36, 349	3, 348	3, 082
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、C V Aリスク	97, 174	85, 362	7, 773	6, 828
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	128	131	10	10
	その他	587	322	49	27
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	91, 463	84, 295	7, 756	7, 148
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）	534, 281	520, 297	42, 742	41, 623
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）	65, 407	61, 122	5, 232	4, 889
	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％）	-	-	-	-
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	72, 977	73, 115	5, 838	5, 849
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	72, 977	73, 115	5, 838	5, 849
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	20, 628	20, 164	1, 650	1, 613
17	うち、標準的方式適用分	20, 628	20, 164	1, 650	1, 613
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	308, 986	308, 986	24, 718	24, 718
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	308, 986	308, 986	24, 718	24, 718
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	62, 479	59, 787	5, 298	5, 070
	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	-	-	-	-
25	合計	5, 807, 367	5, 736, 567	485, 881	480, 097

リスク・アセットの概要（2022年6月末）

【単体】

（単位：百万円）

0V1：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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク		4,534,556	4,505,002	383,803	381,381
2		うち、標準的手法適用分	733	132	58	10
3		うち、内部格付手法適用分	4,383,069	4,371,104	371,684	370,669
		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	150,753	133,764	12,060	10,701
4	カウンターパーティ信用リスク		137,381	122,165	11,182	9,949
5		うち、S A－C C R適用分	－	－	－	－
		うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	39,491	36,349	3,348	3,082
6		うち、期待エクスポージャー方式適用分	－	－	－	－
		うち、C V Aリスク	97,175	85,362	7,774	6,828
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	128	131	10	10
	その他		587	322	49	27
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		120,879	200,288	10,250	16,984
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)		542,445	527,985	43,395	42,238
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)		68,351	61,100	5,468	4,888
	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%)		－	－	－	－
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		72,977	73,115	5,838	5,849
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	72,977	73,115	5,838	5,849
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		20,346	19,714	1,627	1,577
17		うち、標準的方式適用分	20,346	19,714	1,627	1,577
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		265,463	265,463	21,237	21,237
20		うち、基礎的手法適用分	－	－	－	－
21		うち、粗利益配分手法適用分	265,463	265,463	21,237	21,237
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		34,499	34,499	2,925	2,925
	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		－	－	－	－
25	合計		5,796,902	5,809,335	485,729	487,031