

リスク・アセットの概要（2022年9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9月末  | 2022年6月末  | 2022年9月末 | 2022年6月末 |
| 1               | 信用リスク  | 4,489,199 | 4,513,765 | 379,380  | 381,462  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 120,243   | 119,120   | 9,619    | 9,529    |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 4,217,534 | 4,241,898 | 357,646  | 359,712  |
|                 | 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  | 151,420   | 152,746   | 12,113   | 12,219   |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 145,648   | 137,378   | 11,858   | 11,182   |
| 5               | うち、SA-CCR適用分                                     | -         | -         | -        | -        |
|                 | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分                            | 42,968    | 39,488    | 3,643    | 3,348    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -         | -         | -        | -        |
|                 | うち、CVAリスク  | 102,479   | 97,174    | 8,198    | 7,773    |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 88        | 128       | 7        | 10       |
|                 | その他  | 111       | 587       | 9        | 49       |
| 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                       | 89,451    | 91,463    | 7,585    | 7,756    |
| 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）      | 606,330   | 534,281   | 48,506   | 42,742   |
| 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（マデート方式）         | 77,380    | 65,407    | 6,190    | 5,232    |
|                 | 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               | 74,913    | 72,977    | 5,993    | 5,838    |
| 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                                   | 74,913    | 72,977    | 5,993    | 5,838    |
| 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  | 20,892    | 20,628    | 1,671    | 1,650    |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 20,892    | 20,628    | 1,671    | 1,650    |
| 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                                     | 318,627   | 308,986   | 25,490   | 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                                    | 318,627   | 308,986   | 25,490   | 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                 | 68,239    | 62,479    | 5,786    | 5,298    |
|                 | 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   | 5,890,682 | 5,807,367 | 492,462  | 485,881  |

リスク・アセットの概要（2022年9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9月末  | 2022年6月末  | 2022年9月末 | 2022年6月末 |
| 1               | 信用リスク  | 4,485,647 | 4,534,556 | 379,671  | 383,803  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 138       | 733       | 11       | 58       |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 4,337,426 | 4,383,069 | 367,813  | 371,684  |
|                 | 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  | 148,083   | 150,753   | 11,846   | 12,060   |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 145,649   | 137,381   | 11,858   | 11,182   |
| 5               | うち、SA-CCR適用分                                     | -         | -         | -        | -        |
|                 | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分                            | 42,969    | 39,491    | 3,643    | 3,348    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -         | -         | -        | -        |
|                 | うち、CVAリスク  | 102,479   | 97,175    | 8,198    | 7,774    |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 88        | 128       | 7        | 10       |
|                 | その他  | 111       | 587       | 9        | 49       |
| 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                       | 118,141   | 120,879   | 10,018   | 10,250   |
| 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）      | 613,447   | 542,445   | 49,075   | 43,395   |
| 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（マデート方式）         | 85,187    | 68,351    | 6,815    | 5,468    |
|                 | 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               | 74,913    | 72,977    | 5,993    | 5,838    |
| 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                                   | 74,913    | 72,977    | 5,993    | 5,838    |
| 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  | 20,693    | 20,346    | 1,655    | 1,627    |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 20,693    | 20,346    | 1,655    | 1,627    |
| 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                                     | 274,742   | 265,463   | 21,979   | 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                                    | 274,742   | 265,463   | 21,979   | 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   | 5,852,922 | 5,796,902 | 489,992  | 485,729  |