

リスク・アセットの概要（2022年12月末）

【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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	4,542,090	-	383,841	-
2	うち、標準的手法適用分	121,638	-	9,731	-
3	うち、内部格付手法適用分	4,265,540	-	361,717	-
	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	154,911	-	12,392	-
4	カウンターパーティ信用リスク	141,087	-	11,492	-
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	41,549	-	3,523	-
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	98,032	-	7,842	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	236	-	18	-
	その他	1,269	-	107	-
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	87,563	-	7,425	-
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）	609,325	-	48,746	-
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）	75,682	-	6,054	-
	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	68,237	-	5,458	-
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	68,237	-	5,458	-
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	22,367	-	1,789	-
17	うち、標準的方式適用分	22,367	-	1,789	-
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	-	25,490	-
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	-	25,490	-
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	65,172	-	5,526	-
	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	5,930,154	-	495,825	-

リスク・アセットの概要（2022年12月末）

【連結】

（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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	4,434,618	4,489,199	375,333	379,380
2	うち、標準的手法適用分	4,572	120,243	365	9,619
3	うち、内部格付手法適用分	4,284,082	4,217,534	363,290	357,646
	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	145,963	151,420	11,677	12,113
4	カウンターパーティ信用リスク	141,089	145,648	11,492	11,858
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	41,550	42,968	3,523	3,643
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	98,033	102,479	7,842	8,198
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	236	88	18	7
	その他	1,269	111	107	9
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	85,699	89,451	7,267	7,585
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）	607,704	606,330	48,616	48,506
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）	75,682	77,380	6,054	6,190
	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	68,237	74,913	5,458	5,993
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	68,237	74,913	5,458	5,993
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	21,843	20,892	1,747	1,671
17	うち、標準的方式適用分	21,843	20,892	1,747	1,671
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	291,748	318,627	23,339	25,490
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	291,748	318,627	23,339	25,490
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	17,179	68,239	1,456	5,786
	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	5,743,803	5,890,682	480,767	492,462

リスク・アセットの概要（2022年12月末）

【単体】

（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	
		2022年12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	4,519,398	4,485,647	382,547	379,671
2	うち、標準的手法適用分	148	138	11	11
3	うち、内部格付手法適用分	4,374,032	4,337,426	370,917	367,813
	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	145,217	148,083	11,617	11,846
4	カウンターパーティ信用リスク	141,089	145,649	11,492	11,858
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	41,550	42,969	3,523	3,643
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	98,033	102,479	7,842	8,198
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	236	88	18	7
	その他	1,269	111	107	9
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	112,179	118,141	9,512	10,018
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）	622,592	613,447	49,807	49,075
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）	75,682	85,187	6,054	6,815
	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	68,237	74,913	5,458	5,993
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	68,237	74,913	5,458	5,993
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	22,030	20,693	1,762	1,655
17	うち、標準的方式適用分	22,030	20,693	1,762	1,655
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	274,742	21,979	21,979
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	274,742	21,979	21,979
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	916	34,499	77	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	5,836,869	5,852,922	488,693	489,992