

リスク・アセットの概要（2023年3月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	4,266,123		341,289	
2	うち、標準的手法適用分	127,927		10,234	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,794,182		303,534	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	255,089		20,407	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-		-	
	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	88,924		7,113	
6	カウンターパーティ信用リスク	44,428		3,554	
7	うち、SA-CCR適用分	40,730		3,258	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	929		74	
9	その他	2,768		221	
10	CVAリスク	176,214		14,097	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	176,214		14,097	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	78,600		6,288	
12	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）	529,592		42,367	
13	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）	50,118		4,009	
	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%）	-		-	
14	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%）	-		-	
15	未決済取引	-		-	
16	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	77,163		6,173	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,163		6,173	
19	うち、標準的手法方式適用分	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
20	マーケット・リスク	557		44	
21	うち、標準的方式適用分	-		-	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	557		44	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	175,111		14,008	
25	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	61,340		4,907	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	5,459,251		436,740	

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12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 (マンドレート方式)		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（2023年3月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	4,150,698		332,055	
2	うち、標準的手法適用分	8,423		673	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,806,229		304,498	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	255,089		20,407	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-		-	
	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	80,955		6,476	
6	カウンターパーティ信用リスク	44,433		3,554	
7	うち、SA-CCR適用分	40,735		3,258	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	929		74	
9	その他	2,768		221	
10	CVAリスク	176,216		14,097	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	176,216		14,097	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	76,995		6,159	
12	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）	539,352		43,148	
13	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）	50,118		4,009	
	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%）	-		-	
14	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%）	-		-	
15	未決済取引	-		-	
16	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	77,163		6,173	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,163		6,173	
19	うち、標準的手法方式適用分	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
20	マーケット・リスク	990		79	
21	うち、標準的方式適用分	-		-	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	990		79	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	171,834		13,746	
25	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	3,199		255	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	5,291,001		423,280	

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク		4,434,618		375,333
2	うち、標準的手法適用分		4,572		365
3	うち、内部格付手法適用分		4,284,082		363,290
	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		11,677
4	カウンターパーティ信用リスク		141,089		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		41,550		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		98,033		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		85,699		7,267
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		48,616
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		21,843		1,747
17	うち、標準的方式適用分		21,843		1,747
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		23,339
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		23,339
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		1,456
	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		480,767

リスク・アセットの概要（2023年3月末）

【単体】

（単位：百万円）

0V1：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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	4,224,493		337,959	
2	うち、標準的手法適用分	283		22	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,888,581		311,086	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	255,089		20,407	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-		-	
	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	80,538		6,443	
6	カウンターパーティ信用リスク	44,430		3,554	
7	うち、SA-CCR適用分	40,735		3,258	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	929		74	
9	その他	2,765		221	
10	CVAリスク	176,216		14,097	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	176,216		14,097	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	177,476		14,198	
12	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）	538,848		43,107	
13	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）	50,118		4,009	
	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%）	-		-	
14	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%）	-		-	
15	未決済取引	-		-	
16	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	77,163		6,173	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,163		6,173	
19	うち、標準的手法方式適用分	-		-	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
20	マーケット・リスク	980		78	
21	うち、標準的方式適用分	-		-	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	980		78	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	156,243		12,499	
25	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	943		75	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	5,446,914		435,753	

(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3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク		4,519,398		382,547
2	うち、標準的手法適用分		148		11
3	うち、内部格付手法適用分		4,374,032		370,917
	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		11,617
4	カウンターパーティ信用リスク		141,089		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		41,550		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		98,033		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		112,179		9,512
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		49,807
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 (マンドレート方式)		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		22,030		1,762
17	うち、標準的方式適用分		22,030		1,762
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		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		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		77
	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		488,693