

リスク・アセットの概要（2023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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	4,323,035	4,266,123	345,842	341,289
2	うち、標準的手法適用分	127,476	127,927	10,198	10,234
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,827,392	3,794,182	306,191	303,534
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	259,873	255,089	20,789	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	108,292	88,924	8,663	7,113
6	カウンターパーティ信用リスク	43,127	44,428	3,450	3,554
7	うち、SA-CCR適用分	40,344	40,730	3,227	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	646	929	51	74
9	その他	2,136	2,768	170	221
10	CVAリスク	163,774	176,214	13,101	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	163,774	176,214	13,101	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	57,670	78,600	4,613	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）	551,733	529,592	44,138	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）	37,499	50,118	2,999	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	82,422	77,163	6,593	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	82,422	77,163	6,593	6,173
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	488	557	39	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	488	557	39	44
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	175,111	175,111	14,008	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	63,004	61,340	5,040	4,907
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,497,868	5,459,251	439,829	436,740

リスク・アセットの概要（2023年6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6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	4,201,421	4,150,698	336,113	332,055
2	うち、標準的手法適用分	7,816	8,423	625	673
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,839,596	3,806,229	307,167	304,498
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	259,873	255,089	20,789	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	94,134	80,955	7,530	6,476
6	カウンターパーティ信用リスク	43,130	44,433	3,450	3,554
7	うち、SA-CCR適用分	40,346	40,735	3,227	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	646	929	51	74
9	その他	2,136	2,768	170	221
10	CVAリスク	163,775	176,216	13,102	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	163,775	176,216	13,102	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	56,145	76,995	4,491	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）	562,900	539,352	45,032	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（マデート方式）	37,499	50,118	2,999	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%）	1,200	-	96	-
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	82,422	77,163	6,593	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	82,422	77,163	6,593	6,173
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	529	990	42	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	529	990	42	79
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	171,834	171,834	13,746	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	3,209	3,199	256	255
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,324,068	5,291,001	425,925	423,280

リスク・アセットの概要（2023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	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	4,218,116	4,224,493	337,449	337,959
2	うち、標準的手法適用分	238	283	19	22
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,864,576	3,888,581	309,166	311,086
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	259,873	255,089	20,789	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	93,428	80,538	7,474	6,443
6	カウンターパーティ信用リスク	43,130	44,430	3,450	3,554
7	うち、SA-CCR適用分	40,346	40,735	3,227	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	646	929	51	74
9	その他	2,136	2,765	170	221
10	CVAリスク	163,775	176,216	13,102	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	163,775	176,216	13,102	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	156,671	177,476	12,533	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）	562,365	538,848	44,989	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（マデート方式）	37,499	50,118	2,999	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%）	1,200	-	96	-
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	82,422	77,163	6,593	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	82,422	77,163	6,593	6,173
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	468	980	37	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	468	980	37	78
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	156,243	156,243	12,499	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	919	943	73	75
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,422,812	5,446,914	433,824	435,753