

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  | 4,323,035 | 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 |  |           |           |          |          |
|-----------------|--|-----------|-----------|----------|----------|
| 国際様式の<br>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  | 4,201,421 | 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  | 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<br>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（マンドート方式）        | 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  |