

リスク・アセットの概要（2023年9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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	4,227,995	4,323,035	338,239	345,842
2	うち、標準的手法適用分	128,054	127,476	10,244	10,198
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,743,324	3,827,392	299,465	306,191
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	261,866	259,873	20,949	20,789
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	94,749	108,292	7,579	8,663
6	カウンターパーティ信用リスク	43,237	43,127	3,459	3,450
7	うち、SA-CCR適用分	40,179	40,344	3,214	3,227
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	1,297	646	103	51
9	その他	1,761	2,136	140	170
10	CVAリスク	169,184	163,774	13,534	13,101
	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	169,184	163,774	13,534	13,101
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	111,500	57,670	8,920	4,613
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）	544,893	551,733	43,591	44,138
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）	45,573	37,499	3,645	2,999
	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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	1,641	488	131	39
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	1,641	488	131	39
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	181,855	175,111	14,548	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	63,950	63,004	5,116	5,040
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,471,176	5,497,868	437,694	439,829

リスク・アセットの概要（2023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	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	4,111,531	4,201,421	328,922	336,113
2	うち、標準的手法適用分	7,910	7,816	632	625
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,754,818	3,839,596	300,385	307,167
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	261,866	259,873	20,949	20,789
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	86,935	94,134	6,954	7,530
6	カウンターパーティ信用リスク	43,237	43,130	3,459	3,450
7	うち、SA-CCR適用分	40,179	40,346	3,214	3,227
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	1,297	646	103	51
9	その他	1,761	2,136	140	170
10	CVAリスク	169,184	163,775	13,534	13,102
	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	169,184	163,775	13,534	13,102
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	109,403	56,145	8,752	4,491
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）	556,274	562,900	44,501	45,032
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（マンドレート方式）	45,573	37,499	3,645	2,999
	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%）	1,228	1,200	98	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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	1,601	529	128	42
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	1,601	529	128	42
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	177,783	171,834	14,222	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	3,290	3,209	263	256
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,300,454	5,324,068	424,036	425,925

リスク・アセットの概要（2023年9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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	4,113,096	4,218,116	329,047	337,449
2	うち、標準的手法適用分	144	238	11	19
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,764,605	3,864,576	301,168	309,166
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	261,866	259,873	20,949	20,789
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	86,480	93,428	6,918	7,474
6	カウンターパーティ信用リスク	43,237	43,130	3,459	3,450
7	うち、SA-CCR適用分	40,179	40,346	3,214	3,227
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	1,297	646	103	51
9	その他	1,761	2,136	140	170
10	CVAリスク	169,184	163,775	13,534	13,102
	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	169,184	163,775	13,534	13,102
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	213,837	156,671	17,107	12,533
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）	555,679	562,365	44,454	44,989
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）	45,573	37,499	3,645	2,999
	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%）	1,228	1,200	98	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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	81,344	82,422	6,507	6,593
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	1,182	468	94	37
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	1,182	468	94	37
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	163,066	156,243	13,045	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	979	919	78	73
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,388,412	5,422,812	431,072	433,824