

(リスク・アセットの概要)

「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月28日に公表された開示要件(第3の柱)の改訂と題する文書における表に記載された番号を指します。

【2022年6月期(連結)】

(単位:百万円)

| 国際様式の 該当番号 | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
|---------------|--|-----------|-----------|----------|----------|
| | | 2022年6月期 | 2022年3月期 | 2022年6月期 | 2022年3月期 |
| 1 | 信用リスク | 3,559,097 | 3,552,402 | 301,202 | 300,645 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 10,302 | 10,279 | 824 | 822 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 3,432,317 | 3,427,738 | 291,060 | 290,672 |
| | 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 | 116,476 | 114,384 | 9,318 | 9,150 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 107,230 | 89,567 | 8,813 | 7,360 |
| 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 | 30,806 | 23,989 | 2,612 | 2,034 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 57,813 | 48,677 | 4,625 | 3,894 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 362 | 279 | 28 | 22 |
| | その他 | 18,248 | 16,620 | 1,547 | 1,409 |
| 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 | 461,614 | 464,718 | 39,144 | 39,408 |
| 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) | 142,221 | 137,644 | 11,896 | 11,507 |
| 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) | — | — | — | — |
| | 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%) | 5,695 | 8,424 | 482 | 714 |
| 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%) | 434 | 313 | 34 | 25 |
| 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 | 517 | 615 | 41 | 49 |
| 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 | 517 | 615 | 41 | 49 |
| 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 | — | — | — | — |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | — | — | — | — |
| 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 | 160,793 | 160,793 | 12,863 | 12,863 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | — | — | — | — |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | 160,793 | 160,793 | 12,863 | 12,863 |
| 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 | 9 | 9 | 0 | 0 |
| | 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 | 4,437,614 | 4,414,489 | 374,481 | 372,573 |

【2022年6月期（単体）】

（単位：百万円）

| 国際様式の 該当番号 | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
|---------------|--|-----------|-----------|----------|----------|
| | | 2022年6月期 | 2022年3月期 | 2022年6月期 | 2022年3月期 |
| 1 | 信用リスク | 3,536,021 | 3,529,677 | 299,479 | 298,951 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | — | — | — | — |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 3,457,968 | 3,453,507 | 293,235 | 292,857 |
| | 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 | 78,052 | 76,170 | 6,244 | 6,093 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 107,230 | 89,567 | 8,813 | 7,360 |
| 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 | 30,806 | 23,989 | 2,612 | 2,034 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 57,813 | 48,677 | 4,625 | 3,894 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 362 | 279 | 28 | 22 |
| | その他 | 18,248 | 16,620 | 1,547 | 1,409 |
| 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 | 445,354 | 444,069 | 37,766 | 37,657 |
| 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） | 152,518 | 147,709 | 12,769 | 12,360 |
| 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） | — | — | — | — |
| | 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%） | 5,695 | 8,424 | 482 | 714 |
| 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%） | 434 | 313 | 34 | 25 |
| 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 | 517 | 615 | 41 | 49 |
| 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 | 517 | 615 | 41 | 49 |
| 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 | — | — | — | — |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | — | — | — | — |
| 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 | 149,888 | 149,888 | 11,991 | 11,991 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | — | — | — | — |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | 149,888 | 149,888 | 11,991 | 11,991 |
| 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 | — | — | — | — |
| | 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 | 4,397,660 | 4,370,266 | 371,379 | 369,108 |