

(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(マンドレート方式)	—	—	—	—
	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（マンドレート方式）	—	—	—	—
	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