

(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9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9月期	2022年6月期	2022年9月期	2022年6月期
1	信用リスク	3,515,064	3,559,097	297,481	301,202
2	うち、標準的手法適用分	10,108	10,302	808	824
3	うち、内部格付手法適用分	3,390,939	3,432,317	287,551	291,060
	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	114,016	116,476	9,121	9,318
4	カウンターパーティ信用リスク	109,687	107,230	9,017	8,813
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	33,126	30,806	2,809	2,612
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	58,923	57,813	4,713	4,625
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	341	362	27	28
	その他	17,295	18,248	1,466	1,547
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	424,304	461,614	35,981	39,144
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)	135,963	142,221	11,387	11,896
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%)	5,425	5,695	460	482
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%)	376	434	30	34
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	493	517	39	41
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	493	517	39	41
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	163,289	160,793	13,063	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	163,289	160,793	13,063	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	4,354,615	4,437,614	367,461	374,481

【2022年9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9月期	2022年6月期	2022年9月期	2022年6月期
1	信用リスク	3,494,220	3,536,021	295,944	299,479
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,418,189	3,457,968	289,862	293,235
	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	76,030	78,052	6,082	6,244
4	カウンターパーティ信用リスク	109,687	107,230	9,017	8,813
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	33,126	30,806	2,809	2,612
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	58,923	57,813	4,713	4,625
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	341	362	27	28
	その他	17,295	18,248	1,466	1,547
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	404,864	445,354	34,332	37,766
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）	146,248	152,518	12,259	12,769
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%）	5,425	5,695	460	482
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%）	376	434	30	34
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	493	517	39	41
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	493	517	39	41
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	152,399	149,888	12,191	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	152,399	149,888	12,191	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	4,313,716	4,397,660	364,275	371,379