

**連結リスク・アセットの概要**  
(2022年3月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(単位：百万円)

| 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              |                      |
|               |  |           | 当四半期末<br>(2022年3月末) | 前四半期末<br>(2021年12月末) | 当四半期末<br>(2022年3月末) | 前四半期末<br>(2021年12月末) |
| OV1           | リスク・アセットの概要  |           |                     |                      |                     |                      |
| 1             | 信用リスク  | 3,179,155 | 3,143,613           | 268,812              | 265,816             |                      |
| 2             | うち、標準的手法適用分  | 96,243    | 92,165              | 7,699                | 7,373               |                      |
| 3             | うち、内部格付手法適用分   | 3,016,724 | 2,984,919           | 255,818              | 253,121             |                      |
|               | 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  | 66,187    | 66,527              | 5,294                | 5,322               |                      |
| 4             | カウンターパーティ信用リスク                                       | 43,636    | 41,555              | 3,613                | 3,431               |                      |
| 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                                | 14,823    | 15,693              | 1,257                | 1,330               |                      |
| 6             | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                   | -         | -                   | -                    | -                   |                      |
|               | うち、CVAリスク  | 18,047    | 19,219              | 1,443                | 1,537               |                      |
|               | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                                  | 28        | 27                  | 2                    | 2                   |                      |
|               | その他  | 10,737    | 6,615               | 910                  | 560                 |                      |
| 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                           | 506,312   | 508,272             | 42,935               | 43,101              |                      |
| 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<br>(ルックスルー方式)       | 157,354   | 172,971             | 13,343               | 14,667              |                      |
| 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<br>(マnderト方式)       | 77,693    | 67,782              | 6,588                | 5,747               |                      |
|               | 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<br>(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<br>(蓋然性方式400%)      | -         | -                   | -                    | -                   |                      |
| 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<br>(フォールバック方式1250%) | -         | -                   | -                    | -                   |                      |
| 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                   | 7,173     | 6,825               | 573                  | 546                 |                      |
| 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                                       | 7,173     | 6,825               | 573                  | 546                 |                      |
| 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   | 155,064   | 154,017             | 12,405               | 12,321              |                      |
| 20            | うち、基礎的手法適用分  | -         | -                   | -                    | -                   |                      |
| 21            | うち、粗利益配分手法適用分  | 155,064   | 154,017             | 12,405               | 12,321              |                      |
| 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                     | 8,363     | 8,346               | 709                  | 707                 |                      |
|               | 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   | 4,134,755 | 4,103,386           | 348,982              | 346,340             |                      |