

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(連結) |  |                   |                   |                   |                   |
|---------------------|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 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            |                   |
|                     |  | 当期末<br>(2022年3月末) | 前期末<br>(2021年3月末) | 当期末<br>(2022年3月末) | 前期末<br>(2021年3月末) |
| 1                   | 信用リスク  | 7,678,312         | 7,580,302         | 614,265           | 606,424           |
| 2                   | うち、標準的手法適用分                                      | 7,622,881         | 7,524,038         | 609,830           | 601,923           |
| 3                   | うち、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  | 55,431            | 56,263            | 4,434             | 4,501             |
| 4                   | カウンターパーティ信用リスク                                   | 94,134            | 108,497           | 7,530             | 8,679             |
| 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                            | 53,038            | 65,151            | 4,243             | 5,212             |
| 6                   | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                     | うち、CVAリスク  | 40,669            | 42,849            | 3,253             | 3,427             |
|                     | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 334               | 496               | 26                | 39                |
|                     | その他  | 92                | -                 | 7                 | -                 |
| 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                       | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 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)      | 24,193            | 28,453            | 1,935             | 2,276             |
| 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(マナドール方式)        | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                     | 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%)      | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 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%) | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 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               | 3,713             | 2,768             | 297               | 221               |
| 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                                   | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 15                  | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 3,713             | 2,768             | 297               | 221               |
|                     | 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                                     | 210,555           | 202,913           | 16,844            | 16,233            |
| 20                  | うち、基礎的手法適用分                                      | 210,555           | 202,913           | 16,844            | 16,233            |
| 21                  | うち、粗利益配分手法適用分                                    | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 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                 | 121,265           | 126,209           | 9,701             | 10,096            |
|                     | 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   | 8,132,175         | 8,049,144         | 650,574           | 643,931           |

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(連結) |  |                     |                      |                     |                      |
|---------------------|--|---------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| 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) |
| 1                   | 信用リスク  | 7,678,312           | 7,798,067            | 614,265             | 623,845              |
| 2                   | うち、標準的手法適用分                                      | 7,622,881           | 7,741,350            | 609,830             | 619,308              |
| 3                   | うち、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  | 55,431              | 56,716               | 4,434               | 4,537                |
| 4                   | カウンターパーティ信用リスク                                   | 94,134              | 133,377              | 7,530               | 10,670               |
| 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                            | 53,038              | 77,428               | 4,243               | 6,194                |
| 6                   | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -                   | -                    | -                   | -                    |
|                     | うち、CVAリスク  | 40,669              | 55,562               | 3,253               | 4,445                |
|                     | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 334                 | 386                  | 26                  | 30                   |
|                     | その他  | 92                  | -                    | 7                   | -                    |
| 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                       | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 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)      | 24,193              | 27,885               | 1,935               | 2,230                |
| 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%)      | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 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%) | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 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               | 3,713               | 3,604                | 297                 | 288                  |
| 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                                   | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 15                  | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 3,713               | 3,604                | 297                 | 288                  |
|                     | 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                                     | 210,555             | 205,901              | 16,844              | 16,472               |
| 20                  | うち、基礎的手法適用分                                      | 210,555             | 205,901              | 16,844              | 16,472               |
| 21                  | うち、粗利益配分手法適用分                                    | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 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                 | 121,265             | 113,190              | 9,701               | 9,055                |
|                     | 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   | 8,132,175           | 8,282,026            | 650,574             | 662,562              |