

| OV1：リスク・アセットの概要 |                                                  |            |            |           |           |
|-----------------|--------------------------------------------------|------------|------------|-----------|-----------|
| 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    |           |
|                 |                                                  | 2026年6月末   | 2026年3月末   | 2026年6月末  | 2026年3月末  |
| 1               | 信用リスク                                            | 60,134,529 | 60,374,563 | 4,810,762 | 4,829,965 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 7,750,621  | 7,438,097  | 620,049   | 595,047   |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 37,178,728 | 37,493,339 | 2,974,298 | 2,999,467 |
| 4               | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 900,324    | 867,274    | 72,025    | 69,381    |
| 5               | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | 11,711,685 | 11,797,542 | 936,934   | 943,803   |
|                 | 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                      | 6,616      | 7,768      | 529       | 621       |
|                 | その他                                              | 2,586,552  | 2,770,541  | 206,924   | 221,643   |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 2,751,303  | 2,826,805  | 220,104   | 226,144   |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,276,640  | 2,251,976  | 182,131   | 180,158   |
| 8               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 58,205     | 51,747     | 4,656     | 4,139     |
| 9               | その他                                              | 416,456    | 523,081    | 33,316    | 41,846    |
| 10              | CVAリスク                                           | 2,648,440  | 2,588,598  | 211,875   | 207,087   |
|                 | うち、SA-CVA適用分                                     | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | 2,205,576  | 2,182,069  | 176,446   | 174,565   |
|                 | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | 442,863    | 406,528    | 35,429    | 32,522    |
| 11              | 経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー           | 990,342    | 1,015,686  | 79,227    | 81,254    |
| 12              | 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）      | 4,345,099  | 4,533,468  | 347,607   | 362,677   |
| 13              | 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％）      | 47,137     | 43,496     | 3,771     | 3,479     |
|                 | 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％）      | 839,966    | 723,613    | 67,197    | 57,889    |
| 14              | 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％） | 595,161    | 557,990    | 47,612    | 44,639    |
| 15              | 未決済取引                                            | 6          | 5          | 0         | 0         |
| 16              | 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               | 3,365,905  | 3,127,607  | 269,272   | 250,208   |
| 17              | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | 2,336,864  | 2,255,248  | 186,949   | 180,419   |
| 18              | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                           | 236,064    | 230,605    | 18,885    | 18,448    |
| 19              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 748,057    | 641,753    | 59,844    | 51,340    |
|                 | うち、1250％のリスク・ウェイト適用分                             | 44,918     | —          | 3,593     | —         |
| 20              | マーケット・リスク                                        | 4,170,899  | 3,596,624  | 333,671   | 287,729   |
| 21              | うち、標準的方式適用分                                      | 4,113,885  | 3,524,084  | 329,110   | 281,926   |
| 22              | うち、内部モデル方式適用分                                    | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、簡易的方式適用分                                      | 57,014     | 72,540     | 4,561     | 5,803     |
| 23              | 勘定間の振替分                                          | —          | —          | —         | —         |
| 24              | オペレーショナル・リスク                                     | 5,290,906  | 5,290,906  | 423,272   | 423,272   |
| 25              | 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                 | 2,808,847  | 2,796,792  | 224,707   | 223,743   |
| 26              | フロア調整                                            | —          | —          | —         | —         |
| 27              | 合計                                               | 87,988,544 | 87,476,158 | 7,039,083 | 6,998,092 |