

| 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                                            | 68,260,159  | 68,294,951  | 5,460,812 | 5,463,596 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 11,584,366  | 11,275,124  | 926,749   | 902,009   |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 36,847,380  | 37,016,525  | 2,947,790 | 2,961,322 |
| 4               | うち、スロッシング・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                                  | 15,091,621  | 15,133,481  | 1,207,329 | 1,210,678 |
|                 | 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                      | 10,119      | 11,765      | 809       | 941       |
|                 | その他                                              | 3,826,347   | 3,990,780   | 306,107   | 319,262   |
| 6               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,688,117   | 3,719,002   | 295,049   | 297,520   |
| 7               | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,592,720   | 2,548,996   | 207,417   | 203,919   |
| 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                              | 97,961      | 87,704      | 7,836     | 7,016     |
| 9               | その他                                              | 997,436     | 1,082,302   | 79,794    | 86,584    |
| 10              | CVAリスク                                           | 3,159,867   | 3,086,522   | 252,789   | 246,921   |
|                 | うち、SA-CVA適用分                                     | —           | —           | —         | —         |
|                 | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | 2,162,635   | 2,142,534   | 173,010   | 171,402   |
|                 | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | 997,232     | 943,987     | 79,778    | 75,518    |
| 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           | 1,061,621   | 953,215     | 84,929    | 76,257    |
| 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%）      | 332,073     | 288,084     | 26,565    | 23,046    |
|                 | 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%）      | 939,090     | 808,611     | 75,127    | 64,688    |
| 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%） | 657,419     | 660,984     | 52,593    | 52,878    |
| 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               | 3,366,417   | 3,128,328   | 269,313   | 250,266   |
| 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                                  | 748,570     | 642,418     | 59,885    | 51,393    |
|                 | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | 44,918      | 55          | 3,593     | 4         |
| 20              | マーケット・リスク                                        | 5,331,585   | 4,583,341   | 426,526   | 366,667   |
| 21              | うち、標準的方式適用分                                      | 5,208,231   | 4,434,005   | 416,658   | 354,720   |
| 22              | うち、内部モデル方式適用分                                    | —           | —           | —         | —         |
|                 | うち、簡易的方式適用分                                      | 123,353     | 149,335     | 9,868     | 11,946    |
| 23              | 勘定間の振替分                                          | —           | —           | —         | —         |
| 24              | オペレーショナル・リスク                                     | 7,384,012   | 7,384,012   | 590,720   | 590,720   |
| 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                 | 3,602,706   | 3,637,674   | 288,216   | 291,013   |
| 26              | フロア調整                                            | —           | —           | —         | —         |
| 27              | 合計                                               | 102,128,178 | 101,078,201 | 8,170,254 | 8,086,256 |