

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年12月末)

連結

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2021/12)	前四半期末 (2021/9)	当四半期末 (2021/12)	前四半期末 (2021/9)
1	信用リスク	2,007,551	1,974,882	160,604	157,990
2	うち、標準的手法適用分	1,954,059	1,924,426	156,324	153,954
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	53,492	50,456	4,279	4,036
4	カウンターパーティ信用リスク	911	628	72	50
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	577	449	46	35
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	214	137	17	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	119	41	9	3
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)	37,268	34,317	2,981	2,745
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	12,607	12,136	1,008	970
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	10,950	9,517	876	761
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,656	2,619	132	209
	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	71,235	71,235	5,698	5,698
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	71,235	71,235	5,698	5,698
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	2,129,576	2,093,201	170,366	167,456

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年12月末)

単体

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2021/12)	前四半期末 (2021/9)	当四半期末 (2021/12)	前四半期末 (2021/9)
1	信用リスク	1,963,823	1,932,157	157,105	154,572
2	うち、標準的手法適用分	1,925,076	1,893,912	154,006	151,513
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	38,747	38,245	3,099	3,059
4	カウンターパーティ信用リスク	911	628	72	50
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	577	449	46	35
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	214	137	17	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	119	41	9	3
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)	37,250	34,299	2,980	2,743
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(マニフェスト方式)	-	-	-	-
	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%方式)	-	-	-	-
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	12,607	12,136	1,008	970
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	10,950	9,517	876	761
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,656	2,619	132	209
	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	65,645	65,645	5,251	5,251
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	65,645	65,645	5,251	5,251
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	2,080,239	2,044,867	166,419	163,589