

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2020年9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 (2020/9)	前四半期末 (2020/6)	当四半期末 (2020/9)	前四半期末 (2020/6)
1	信用リスク	1,977,056	2,018,150	158,164	161,452
2	うち、標準的手法適用分	1,927,633	1,967,681	154,210	157,414
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	49,423	50,468	3,953	4,037
4	カウンターパーティ信用リスク	666	737	53	58
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	481	511	38	40
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	162	184	12	14
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	23	41	1	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)	22,763	19,584	1,821	1,566
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	10,224	9,849	817	787
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	9,424	9,501	753	760
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	799	348	63	27
	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	66,504	66,801	5,320	5,344
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	66,504	66,801	5,320	5,344
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	2,077,215	2,115,124	166,177	169,209

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2020年9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 (2020/9)	前四半期末 (2020/6)	当四半期末 (2020/9)	前四半期末 (2020/6)
1	信用リスク	1,938,668	1,980,573	155,093	158,445
2	うち、標準的手法適用分	1,901,052	1,941,870	152,084	155,349
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	37,615	38,703	3,009	3,096
4	カウンターパーティ信用リスク	666	737	53	58
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	481	511	38	40
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	162	184	12	14
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	23	41	1	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)	22,754	19,575	1,820	1,566
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	10,224	9,849	817	787
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	9,424	9,501	753	760
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	799	348	63	27
	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	62,695	62,548	5,015	5,003
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	62,695	62,548	5,015	5,003
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	2,035,009	2,073,284	162,800	165,862