■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		1		/\	=
の該当番		リスク・アセット		 所要自	
号		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ー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(マンデート方式)	_	_	-	_
	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%) 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	-	-	-	_
10	みなし計算(フォールバック方式1250%)	-	-	-	_
11	未決済取引 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	_	_	_	
12	信用リスグ・アセットの額の昇田対象となっている証券化 エクスポージャー うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適	10,224	9,849	817	787
13	プラ、内部格別・子法学拠グ式又は内部計画が大適 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	20.504	22.224		
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 特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係る工	_		_	
	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)

2		_ t _ t _ t _ t _ t _ ne - ne				(単位:日万円)	
1							
1 信用リスク	国際様式		1		//	=	
(2020/9) (2020/9	の該当番		リスク・アセット		所要自	所要自己資本	
2	号						
3 うち. 内部格付手法適用分	1	信用リスク	1,938,668	1,980,573	155,093	158,445	
55. 重要な出資のエクスポージャー 55. 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	2	うち、標準的手法適用分	1,901,052	1,941,870	152,084	155,349	
15. リース取引における見積残存価額のエクスポーシャー	3	うち、内部格付手法適用分	_	_	1	l	
ジャー その他 37.615 38,703 3,009 3,009 3,009 4 カウンターバーティ信用リスク 6666 737 53 5 55. SA-CCR適用分		うち、重要な出資のエクスポージャー	_	_	1	l	
カウンターバーティ信用リスク			_	-	1	_	
55 SA-CCR適用分		その他	37,615	38,703	3,009	3,096	
うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	4	カウンターパーティ信用リスク	666	737	53	58	
55、期待エクスポージャー方式適用分	5	うち、SAーCCR適用分	_	_	1	-	
うち、CVAリスク		うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	481	511	38	40	
うち、中央清算機関関連エクスポージャー	6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	_		1		
その他 23 41 1 1 1 1 1 1 1 1		うち、CVAリスク	162	184	12	14	
マーケット・ペース方式に基づく株式等エクスポージャー		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	_	1	-		
8		その他	23	41	1	3	
8 みなし計算(ルック・スルー方式) 9 カス・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットの	7		_	-	1	_	
9 みなし計算(マンデート方式) -	8	みなし計算(ルック・スルー方式)	22,754	19,575	1,820	1,566	
みなし計算(蓋然性方式250%)	9	みなし計算(マンデート方式)	-	_	_		
おなし計算(蓋然性方式400%)		みなし計算(蓋然性方式250%)	-	-	-	_	
10 みなし計算(フォールバック方式1250%方式)		みなし計算(蓋然性方式400%)	-	_	_	_	
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		みなし計算(フォールバック方式1250%方式)	-	_	_	_	
12	11		-	_	-	_	
用分	12	エクスポージャー	10,224	9,849	817	787	
15 うち、標準的手法準拠方式適用分 799 348 63 2 2 3 5 1250%のリスク・ウェイト適用分 16 マーケット・リスク うち、標準的方式適用分 うち、標準的方式適用分 うち、内部モデル方式適用分 うち、内部モデル方式適用分 5 5 5 5 5 5 5 5 5	13		-	_	_	_	
うち、1250%のリスク・ウェイト適用分			,	,		760	
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 5,00 20 うち、基礎的手法適用分	15		799	348	63	27	
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 5,00 20 うち、基礎的手法適用分							
18 うち、内部モデル方式適用分 62,695 62,548 5,015 5,00 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 5,00 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		マーケット・リスク					
19 オペレーショナル・リスク 62,695 62,548 5,015 5,000 20 うち、基礎的手法適用分	17						
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 5,00 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 - -		1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1					
21 うち、粗利益配分手法適用分 62,695 62,548 5,015 5,000 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			62,695	62,548	5,015	5,003	
22 うち、先進的計測手法適用分	20	うち、基礎的手法適用分	-	_	-	_	
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ータスポージャー			62,695	62,548	5,015	5,003	
23 クスポージャー -	22		_	_	_	_	
額 24 フロア調整	23	クスポージャー	-	_	-	_	
24 フロア調整			_	_	-	-	
	24						
			2,035,009	2,073,284	162,800	165,862	