

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/9)	前四半期末 (2022/6)	当四半期末 (2022/9)	前四半期末 (2022/6)
1	信用リスク	2,055,444	2,013,689	164,435	161,095
2	うち、標準的手法適用分	2,002,405	1,957,642	160,192	156,611
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	53,039	56,046	4,243	4,483
4	カウンターパーティ信用リスク	1,014	1,035	81	82
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	454	523	36	41
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	186	207	14	16
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	373	303	29	24
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)	54,679	47,179	4,374	3,774
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	13,981	12,447	1,118	995
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	12,340	10,794	987	863
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,640	1,652	131	132
	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	75,216	73,416	6,017	5,873
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	75,216	73,416	6,017	5,873
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	2,200,336	2,147,767	176,026	171,821

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/9)	前四半期末 (2022/6)	当四半期末 (2022/9)	前四半期末 (2022/6)
1	信用リスク	2,013,557	1,972,749	161,084	157,819
2	うち、標準的手法適用分	1,974,113	1,930,733	157,929	154,458
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	39,444	42,016	3,155	3,361
4	カウンターパーティ信用リスク	1,014	1,035	81	82
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	454	523	36	41
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	186	207	14	16
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	373	303	29	24
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)	54,655	47,156	4,372	3,772
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%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	13,981	12,447	1,118	995
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	12,340	10,794	987	863
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,640	1,652	131	132
	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	69,908	67,804	5,592	5,424
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	69,908	67,804	5,592	5,424
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	2,153,117	2,101,194	172,249	168,095