

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/12) | 前四半期末 (2022/9) | 当四半期末 (2022/12) | 前四半期末 (2022/9) |
| 1 | 信用リスク | 2,094,575 | 2,055,444 | 167,566 | 164,435 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 2,036,401 | 2,002,405 | 162,912 | 160,192 |
| 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 | 58,174 | 53,039 | 4,653 | 4,243 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 2,684 | 1,014 | 214 | 81 |
| 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 | 1,301 | 454 | 104 | 36 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 619 | 186 | 49 | 14 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | - | - | - | - |
| | その他 | 763 | 373 | 61 | 29 |
| 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) | 65,371 | 54,679 | 5,229 | 4,374 |
| 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 | 13,858 | 13,981 | 1,108 | 1,118 |
| 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 | 12,358 | 12,340 | 988 | 987 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | 1,499 | 1,640 | 119 | 131 |
| | 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 | 75,216 | 6,017 | 6,017 |
| 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 | 75,216 | 6,017 | 6,017 |
| 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 | 2,251,706 | 2,200,336 | 180,136 | 176,026 |

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/12) | 前四半期末 (2022/9) | 当四半期末 (2022/12) | 前四半期末 (2022/9) |
| 1 | 信用リスク | 2,051,102 | 2,013,557 | 164,088 | 161,084 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 2,008,933 | 1,974,113 | 160,714 | 157,929 |
| 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 | 42,168 | 39,444 | 3,373 | 3,155 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 2,684 | 1,014 | 214 | 81 |
| 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 | 1,301 | 454 | 104 | 36 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 619 | 186 | 49 | 14 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | - | - | - | - |
| | その他 | 763 | 373 | 61 | 29 |
| 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) | 65,349 | 54,655 | 5,227 | 4,372 |
| 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 | 13,858 | 13,981 | 1,108 | 1,118 |
| 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 | 12,358 | 12,340 | 988 | 987 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | 1,499 | 1,640 | 119 | 131 |
| | 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 | 69,908 | 5,592 | 5,592 |
| 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 | 69,908 | 5,592 | 5,592 |
| 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 | 2,202,903 | 2,153,117 | 176,232 | 172,249 |