

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年3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 (2023/3)	前四半期末 (2022/12)	当四半期末 (2023/3)	前四半期末 (2022/12)
1	信用リスク	2,184,758	2,094,575	174,780	167,566
2	うち、標準的手法適用分	2,130,612	2,036,401	170,449	162,912
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	54,146	58,174	4,331	4,653
4	カウンターパーティ信用リスク	3,682	2,684	294	214
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	883	1,301	70	104
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,041	619	163	49
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	757	763	60	61
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)	74,793	65,371	5,983	5,229
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	18,090	13,858	1,447	1,108
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	13,872	12,358	1,109	988
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,218	1,499	337	119
	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	76,560	75,216	6,124	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	76,560	75,216	6,124	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	2,357,885	2,251,706	188,630	180,136

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年3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 (2023/3)	前四半期末 (2022/12)	当四半期末 (2023/3)	前四半期末 (2022/12)
1	信用リスク	2,147,331	2,051,102	171,786	164,088
2	うち、標準的手法適用分	2,108,244	2,008,933	168,659	160,714
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	39,087	42,168	3,127	3,373
4	カウンターパーティ信用リスク	3,682	2,684	294	214
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	883	1,301	70	104
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,041	619	163	49
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	757	763	60	61
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)	74,771	65,349	5,981	5,227
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(マં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%)	—	—	—	—
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	18,090	13,858	1,447	1,108
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	13,872	12,358	1,109	988
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,218	1,499	337	119
	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	71,169	69,908	5,693	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	71,169	69,908	5,693	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	2,315,046	2,202,903	185,203	176,232