

■OV1:リスク・アセットの概要 (2020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 (2020/12)	前四半期末 (2020/9)	当四半期末 (2020/12)	前四半期末 (2020/9)
1	信用リスク	1,980,150	1,977,056	158,412	158,164
2	うち、標準的手法適用分	1,928,368	1,927,633	154,269	154,210
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	51,781	49,423	4,142	3,953
4	カウンターパーティ信用リスク	910	666	72	53
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	569	481	45	38
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	196	162	15	12
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	144	23	11	1
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)	25,943	22,763	2,075	1,821
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	10,611	10,224	848	817
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	9,260	9,424	740	753
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,351	799	108	63
	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	66,504	5,320	5,320
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	66,504	5,320	5,320
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	2,084,120	2,077,215	166,729	166,177

■OV1:リスク・アセットの概要 (2020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 (2020/12)	前四半期末 (2020/9)	当四半期末 (2020/12)	前四半期末 (2020/9)
1	信用リスク	1,942,195	1,938,668	155,375	155,093
2	うち、標準的手法適用分	1,903,708	1,901,052	152,296	152,084
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	38,486	37,615	3,078	3,009
4	カウンターパーティ信用リスク	910	666	72	53
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	569	481	45	38
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	196	162	15	12
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	144	23	11	1
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)	25,934	22,754	2,074	1,820
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	10,611	10,224	848	817
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	9,260	9,424	740	753
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,351	799	108	63
	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	62,695	5,015	5,015
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	62,695	5,015	5,015
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	2,042,347	2,035,009	163,387	162,800