

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年6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 (2021/6)	前四半期末 (2021/3)	当四半期末 (2021/6)	前四半期末 (2021/3)
1	信用リスク	1,967,384	1,967,460	157,390	157,396
2	うち、標準的手法適用分	1,916,150	1,917,048	153,292	153,363
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	51,233	50,411	4,098	4,032
4	カウンターパーティ信用リスク	771	654	61	52
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	519	460	41	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	180	146	14	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	70	47	5	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)	33,215	30,591	2,657	2,447
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	12,466	11,717	997	937
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	9,841	10,160	787	812
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,625	1,556	210	124
	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	67,839	67,839	5,427	5,427
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	67,839	67,839	5,427	5,427
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	2,081,677	2,078,262	166,534	166,260

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年6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 (2021/6)	前四半期末 (2021/3)	当四半期末 (2021/6)	前四半期末 (2021/3)
1	信用リスク	1,926,024	1,924,498	154,081	153,959
2	うち、標準的手法適用分	1,886,637	1,885,909	150,931	150,872
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	39,386	38,588	3,150	3,087
4	カウンターパーティ信用リスク	771	654	61	52
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	519	460	41	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	180	146	14	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	70	47	5	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)	33,201	30,581	2,656	2,446
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	12,466	11,717	997	937
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	9,841	10,160	787	812
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,625	1,556	210	124
	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	64,024	64,024	5,121	5,121
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	64,024	64,024	5,121	5,121
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	2,036,488	2,031,475	162,919	162,518