

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/3)	前四半期末 (2021/12)	当四半期末 (2022/3)	前四半期末 (2021/12)
1	信用リスク	2,021,093	2,007,551	161,687	160,604
2	うち、標準的手法適用分	1,967,790	1,954,059	157,423	156,324
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	53,303	53,492	4,264	4,279
4	カウンターパーティ信用リスク	679	911	54	72
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	431	577	34	46
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	148	214	11	17
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	100	119	8	9
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)	42,106	37,268	3,368	2,981
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	12,527	12,607	1,002	1,008
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	10,877	10,950	870	876
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,649	1,656	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	73,416	71,235	5,873	5,698
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	73,416	71,235	5,873	5,698
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	2,149,823	2,129,576	171,985	170,366

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/3)	前四半期末 (2021/12)	当四半期末 (2022/3)	前四半期末 (2021/12)
1	信用リスク	1,975,909	1,963,823	158,072	157,105
2	うち、標準的手法適用分	1,936,173	1,925,076	154,893	154,006
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	39,736	38,747	3,178	3,099
4	カウンターパーティ信用リスク	679	911	54	72
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	431	577	34	46
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	148	214	11	17
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	100	119	8	9
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)	42,083	37,250	3,366	2,980
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	12,527	12,607	1,002	1,008
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	10,877	10,950	870	876
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,649	1,656	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	67,804	65,645	5,424	5,251
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	67,804	65,645	5,424	5,251
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	2,099,005	2,080,239	167,920	166,419