

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/6)	前四半期末 (2022/3)	当四半期末 (2022/6)	前四半期末 (2022/3)
1	信用リスク	2,013,689	2,021,093	161,095	161,687
2	うち、標準的手法適用分	1,957,642	1,967,790	156,611	157,423
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	56,046	53,303	4,483	4,264
4	カウンターパーティ信用リスク	1,035	679	82	54
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	523	431	41	34
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	207	148	16	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	303	100	24	8
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)	47,179	42,106	3,774	3,368
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	12,447	12,527	995	1,002
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	10,794	10,877	863	870
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,652	1,649	132	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	73,416	73,416	5,873	5,873
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	73,416	5,873	5,873
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	2,147,767	2,149,823	171,821	171,985

■OV1:リスク・アセットの概要 (2022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 (2022/6)	前四半期末 (2022/3)	当四半期末 (2022/6)	前四半期末 (2022/3)
1	信用リスク	1,972,749	1,975,909	157,819	158,072
2	うち、標準的手法適用分	1,930,733	1,936,173	154,458	154,893
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	42,016	39,736	3,361	3,178
4	カウンターパーティ信用リスク	1,035	679	82	54
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	523	431	41	34
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	207	148	16	11
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	303	100	24	8
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)	47,156	42,083	3,772	3,366
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	12,447	12,527	995	1,002
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	10,794	10,877	863	870
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,652	1,649	132	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	67,804	67,804	5,424	5,424
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	67,804	5,424	5,424
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	2,101,194	2,099,005	168,095	167,920