

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021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 (2021/3)	前四半期末 (2020/12)	当四半期末 (2021/3)	前四半期末 (2020/12)
1	信用リスク	1,967,460	1,980,150	157,396	158,412
2	うち、標準的手法適用分	1,917,048	1,928,368	153,363	154,269
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	50,411	51,781	4,032	4,142
4	カウンターパーティ信用リスク	654	910	52	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	460	569	36	45
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	146	196	11	15
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	47	144	3	11
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)	30,591	25,943	2,447	2,075
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	11,717	10,611	937	848
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	10,160	9,260	812	740
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,556	1,351	124	108
	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	66,504	5,427	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	67,839	66,504	5,427	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	2,078,262	2,084,120	166,260	166,729

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021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 (2021/3)	前四半期末 (2020/12)	当四半期末 (2021/3)	前四半期末 (2020/12)
1	信用リスク	1,924,498	1,942,195	153,959	155,375
2	うち、標準的手法適用分	1,885,909	1,903,708	150,872	152,296
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	38,588	38,486	3,087	3,078
4	カウンターパーティ信用リスク	654	910	52	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	460	569	36	45
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	146	196	11	15
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	47	144	3	11
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)	30,581	25,934	2,446	2,074
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	11,717	10,611	937	848
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	10,160	9,260	812	740
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,556	1,351	124	108
	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	62,695	5,121	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	64,024	62,695	5,121	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	2,031,475	2,042,347	162,518	163,387