

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年9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 (2021/9)	前四半期末 (2021/6)	当四半期末 (2021/9)	前四半期末 (2021/6)
1	信用リスク	1,974,882	1,967,384	157,990	157,390
2	うち、標準的手法適用分	1,924,426	1,916,150	153,954	153,292
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	50,456	51,233	4,036	4,098
4	カウンターパーティ信用リスク	628	771	50	61
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	449	519	35	41
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	137	180	11	14
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	41	70	3	5
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)	34,317	33,215	2,745	2,657
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	12,136	12,466	970	997
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	9,517	9,841	761	787
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,619	2,625	209	210
	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	71,235	67,839	5,698	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	71,235	67,839	5,698	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	2,093,201	2,081,677	167,456	166,534

■OV1:リスク・アセットの概要 (2021年9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 (2021/9)	前四半期末 (2021/6)	当四半期末 (2021/9)	前四半期末 (2021/6)
1	信用リスク	1,932,157	1,926,024	154,572	154,081
2	うち、標準的手法適用分	1,893,912	1,886,637	151,513	150,931
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	38,245	39,386	3,059	3,150
4	カウンターパーティ信用リスク	628	771	50	61
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	449	519	35	41
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	137	180	11	14
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	41	70	3	5
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)	34,299	33,201	2,743	2,656
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	12,136	12,466	970	997
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	9,517	9,841	761	787
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,619	2,625	209	210
	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	65,645	64,024	5,251	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	65,645	64,024	5,251	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	2,044,867	2,036,488	163,589	162,919