

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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	4,486,633	4,505,835	379,235	380,826
2	うち、標準的手法適用分	120,043	117,052	9,603	9,364
3	うち、内部格付手法適用分	4,230,107	4,241,661	358,713	359,692
	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	136,481	147,121	10,918	11,769
4	カウンターパーティ信用リスク	122,165	114,050	9,949	9,290
5	うち、SA-C-C-R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	36,349	33,945	3,082	2,878
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	85,362	79,196	6,828	6,335
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	131	202	10	16
	その他	322	706	27	59
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	84,295	107,527	7,148	9,118
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）	520,297	596,677	41,623	47,734
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（マンドレート方式）	61,122	60,904	4,889	4,872
	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	73,115	36,847	5,849	2,947
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	73,115	36,847	5,849	2,947
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	20,164	19,406	1,613	1,552
17	うち、標準的方式適用分	20,164	19,406	1,613	1,552
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	308,986	302,114	24,718	24,169
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	308,986	302,114	24,718	24,169
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	59,787	60,586	5,070	5,137
	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	5,736,567	5,803,951	480,097	485,649

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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	4,505,002	4,516,664	381,381	382,323
2	うち、標準的手法適用分	132	162	10	12
3	うち、内部格付手法適用分	4,371,104	4,372,943	370,669	370,825
	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	133,764	143,558	10,701	11,484
4	カウンターパーティ信用リスク	122,165	114,052	9,949	9,290
5	うち、SA-C-C-R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	36,349	33,946	3,082	2,878
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	85,362	79,196	6,828	6,335
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	131	202	10	16
	その他	322	706	27	59
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	200,288	223,088	16,984	18,917
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）	527,985	605,336	42,238	48,426
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（マンドレート方式）	61,100	60,904	4,888	4,872
	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	73,115	36,847	5,849	2,947
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	73,115	36,847	5,849	2,947
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	19,714	19,195	1,577	1,535
17	うち、標準的方式適用分	19,714	19,195	1,577	1,535
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	265,463	259,133	21,237	20,730
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	265,463	259,133	21,237	20,730
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	34,499	34,499	2,925	2,925
	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	5,809,335	5,869,721	487,031	491,970