

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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	4,541,361	4,572,740	383,890	386,531
2	うち、標準的手法適用分	116,203	115,254	9,296	9,220
3	うち、内部格付手法適用分	4,287,821	4,315,146	363,607	365,924
	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	137,336	142,338	10,986	11,387
4	カウンターパーティ信用リスク	117,373	119,613	9,560	9,738
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	33,771	34,432	2,863	2,919
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	81,764	84,189	6,541	6,735
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	131	101	10	8
	その他	1,706	889	144	75
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	128,463	135,913	10,893	11,525
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）	535,921	457,324	42,873	36,585
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）	82,929	61,000	6,634	4,880
	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%）	3,967	3,795	336	321
	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	-	2	-	0
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	37,807	31,608	3,024	2,528
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	37,807	31,608	3,024	2,528
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	19,573	18,990	1,565	1,519
17	うち、標準的方式適用分	19,573	18,990	1,565	1,519
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	302,114	302,295	24,169	24,183
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	302,114	302,295	24,169	24,183
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	58,171	56,185	4,932	4,764
	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	5,827,684	5,759,469	487,881	482,580

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	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	4,538,957	4,605,411	384,261	389,872
2	うち、標準的手法適用分	197	207	15	16
3	うち、内部格付手法適用分	4,405,241	4,466,641	373,564	378,771
	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	133,518	138,562	10,681	11,085
4	カウンターパーティ信用リスク	117,400	119,625	9,562	9,739
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	33,792	34,441	2,865	2,920
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	81,770	84,192	6,541	6,735
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	131	101	10	8
	その他	1,706	889	144	75
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	330,382	337,920	28,016	28,655
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）	544,895	466,791	43,591	37,343
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）	82,929	61,000	6,634	4,880
	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%）	3,967	3,795	336	321
	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	-	2	-	0
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	37,807	31,608	3,024	2,528
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	37,807	31,608	3,024	2,528
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	18,627	18,453	1,490	1,476
17	うち、標準的方式適用分	18,627	18,453	1,490	1,476
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	259,133	259,532	20,730	20,762
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	259,133	259,532	20,730	20,762
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	31,499	31,499	2,671	2,671
	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	5,965,601	5,935,642	500,319	498,252