

リスク・アセットの概要 (2021年12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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	4,505,835	4,541,361	380,826	383,890
2	うち、標準的手法適用分	117,052	116,203	9,364	9,296
3	うち、内部格付手法適用分	4,241,661	4,287,821	359,692	363,607
	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	147,121	137,336	11,769	10,986
4	カウンターパーティ信用リスク	114,050	117,373	9,290	9,560
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	33,945	33,771	2,878	2,863
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	79,196	81,764	6,335	6,541
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	202	131	16	10
	その他	706	1,706	59	144
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	107,527	128,463	9,118	10,893
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)	596,677	535,921	47,734	42,873
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)	60,904	82,929	4,872	6,634
	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	-	336
	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	36,847	37,807	2,947	3,024
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	36,847	37,807	2,947	3,024
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	19,406	19,573	1,552	1,565
17	うち、標準的方式適用分	19,406	19,573	1,552	1,565
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	302,114	24,169	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	302,114	302,114	24,169	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	60,586	58,171	5,137	4,932
	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	5,803,951	5,827,684	485,649	487,881

リスク・アセットの概要（2021年12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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	4,516,664	4,538,957	382,323	384,261
2	うち、標準的手法適用分	162	197	12	15
3	うち、内部格付手法適用分	4,372,943	4,405,241	370,825	373,564
	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	143,558	133,518	11,484	10,681
4	カウンターパーティ信用リスク	114,052	117,400	9,290	9,562
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	33,946	33,792	2,878	2,865
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	79,196	81,770	6,335	6,541
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	202	131	16	10
	その他	706	1,706	59	144
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	223,088	330,382	18,917	28,016
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）	605,336	544,895	48,426	43,591
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）	60,904	82,929	4,872	6,634
	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	-	336
	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	36,847	37,807	2,947	3,024
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	36,847	37,807	2,947	3,024
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	19,195	18,627	1,535	1,490
17	うち、標準的方式適用分	19,195	18,627	1,535	1,490
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	259,133	20,730	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	259,133	259,133	20,730	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	31,499	2,925	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	5,869,721	5,965,601	491,970	500,319