

リスク・アセットの概要（2021年3月末・確定値）

【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3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	4,971,534	4,882,364	420,667	413,075
2	うち、標準的手法適用分	62,297	67,740	4,983	5,419
3	うち、内部格付手法適用分	4,780,071	4,684,686	405,350	397,261
	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	7,358	7,126	588	570
	その他	121,807	122,810	9,744	9,824
4	カウンターパーティ信用リスク	139,043	137,925	11,311	11,225
5	うち、SA-CCR適用分	38,524	39,294	3,266	3,332
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	99,529	97,627	7,962	7,810
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	415	389	33	31
	その他	573	614	48	52
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	245,802	246,718	20,844	20,921
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)	883,791	782,102	74,871	66,197
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)	76,914	78,148	6,153	6,251
	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%)	1,645	2,072	131	165
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	966	1,045	77	83
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	966	989	77	79
14	うち、外部格付準拠方式適用分	-	56	-	4
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	132,370	130,259	10,589	10,420
17	うち、標準的方式適用分	132,370	130,259	10,589	10,420
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	300,951	297,869	24,076	23,829
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	300,951	297,869	24,076	23,829
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	31,183	31,124	2,644	2,639
	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	956,646	1,107,501	76,531	88,600
25	合計	7,740,850	7,697,133	647,897	643,412

(注)1.「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2.内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。

## 【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3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	4,926,151	4,836,023	417,056	409,392
2	うち、標準的手法適用分	20,583	24,039	1,646	1,923
3	うち、内部格付手法適用分	4,784,252	4,689,666	405,704	397,683
	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	121,315	122,317	9,705	9,785
4	カウンターパーティ信用リスク	139,043	137,925	11,311	11,225
5	うち、SA-CCR適用分	38,524	39,294	3,266	3,332
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	99,529	97,627	7,962	7,810
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	415	389	33	31
	その他	573	614	48	52
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	176,776	179,112	14,990	15,188
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)	883,791	782,102	74,871	66,197
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)	76,914	78,148	6,153	6,251
	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%)	1,645	2,072	131	165
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	966	1,045	77	83
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	966	989	77	79
14	うち、外部格付準拠方式適用分	-	56	-	4
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	131,409	129,323	10,512	10,345
17	うち、標準的方式適用分	131,409	129,323	10,512	10,345
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	282,467	279,696	22,597	22,375
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	282,467	279,696	22,597	22,375
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	11,187	11,752	948	996
	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	859,412	923,896	68,752	73,911
25	合計	7,489,766	7,361,099	627,403	616,135

(注)1.「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2.内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。