

## リスク・アセットの概要（2021年6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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	5,004,906	4,971,534	423,501	420,667
2	うち、標準的手法適用分	61,905	62,297	4,952	4,983
3	うち、内部格付手法適用分	4,814,467	4,780,071	408,266	405,350
	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	7,595	7,358	607	588
	その他	120,937	121,807	9,674	9,744
4	カウンターパーティ信用リスク	130,038	139,043	10,582	11,311
5	うち、SA-CCR適用分	36,363	38,524	3,083	3,266
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	92,262	99,529	7,381	7,962
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	443	415	35	33
	その他	969	573	82	48
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	258,069	245,802	21,884	20,844
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)	903,092	883,791	76,470	74,871
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)	70,955	76,914	5,676	6,153
	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%)	1,500	1,645	120	131
11	未決済取引	0	-	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	981	966	78	77
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	981	966	78	77
14	うち、外部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
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	131,046	132,370	10,483	10,589
17	うち、標準的方式適用分	131,046	132,370	10,483	10,589
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	300,951	24,076	24,076
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	300,951	24,076	24,076
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	32,901	31,183	2,790	2,644
	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	1,078,281	956,646	86,262	76,531
25	合計	7,912,726	7,740,850	661,926	647,897

(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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	4,961,008	4,926,151	420,013	417,056
2	うち、標準的手法適用分	21,316	20,583	1,705	1,646
3	うち、内部格付手法適用分	4,819,229	4,784,252	408,670	405,704
	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	120,462	121,315	9,637	9,705
4	カウンターパーティ信用リスク	130,038	139,043	10,582	11,311
5	うち、SA-CCR適用分	36,363	38,524	3,083	3,266
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	92,262	99,529	7,381	7,962
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	443	415	35	33
	その他	969	573	82	48
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	190,926	176,776	16,190	14,990
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)	903,092	883,791	76,470	74,871
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)	70,955	76,914	5,676	6,153
	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%)	1,500	1,645	120	131
11	未決済取引	0	-	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	981	966	78	77
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	981	966	78	77
14	うち、外部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
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	129,919	131,409	10,393	10,512
17	うち、標準的方式適用分	129,919	131,409	10,393	10,512
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	282,467	22,597	22,597
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	282,467	22,597	22,597
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	12,110	11,187	1,026	948
	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	971,881	859,412	77,750	68,752
25	合計	7,654,884	7,489,766	640,899	627,403

(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。