

リスク・アセットの概要（2021年9月末・速報値）

【連結】

（単位：百万円）

OV1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		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	4,980,443	5,004,906	421,415	423,501
2	うち、標準的手法適用分	63,930	61,905	5,114	4,952
3	うち、内部格付手法適用分	4,787,518	4,814,467	405,981	408,266
	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	7,847	7,595	627	607
	その他	121,147	120,937	9,691	9,674
4	カウンターパーティ信用リスク	117,372	130,038	9,551	10,582
5	うち、SA-CCR適用分	32,839	36,363	2,784	3,083
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,287	92,262	6,663	7,381
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	400	443	32	35
	その他	844	969	71	82
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	261,566	258,069	22,180	21,884
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)	989,849	903,092	83,864	76,470
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)	27,603	70,955	2,208	5,676
	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%)	1,302	1,500	104	120
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	-	78
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	-	78
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	140,844	131,046	11,267	10,483
17	うち、標準的方式適用分	140,844	131,046	11,267	10,483
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	305,777	300,951	24,462	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	305,777	300,951	24,462	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	33,153	32,901	2,811	2,790
	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	1,103,948	1,078,281	88,315	86,262
25	合計	7,961,861	7,912,726	666,182	661,926

(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。

【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	4,927,219	4,961,008	417,151	420,013
2	うち、標準的手法適用分	20,204	21,316	1,616	1,705
3	うち、内部格付手法適用分	4,786,323	4,819,229	405,880	408,670
	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	120,690	120,462	9,655	9,637
4	カウンターパーティ信用リスク	117,372	130,038	9,551	10,582
5	うち、SA-CCR適用分	32,839	36,363	2,784	3,083
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,287	92,262	6,663	7,381
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	400	443	32	35
	その他	844	969	71	82
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	189,667	190,926	16,083	16,190
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)	989,849	903,092	83,864	76,470
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)	27,603	70,955	2,208	5,676
	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%)	1,302	1,500	104	120
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	-	78
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	-	78
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	139,809	129,919	11,184	10,393
17	うち、標準的方式適用分	139,809	129,919	11,184	10,393
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	287,525	282,467	23,002	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	287,525	282,467	23,002	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 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	12,028	12,110	1,020	1,026
24	フロア調整	1,005,635	971,881	80,450	77,750
25	合計	7,698,012	7,654,884	644,622	640,899

(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。