

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	4,983,843	4,980,443	421,666	421,415
2	うち、標準的手法適用分	72,529	63,930	5,802	5,114
3	うち、内部格付手法適用分	4,783,176	4,787,518	405,613	405,981
	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	8,151	7,847	652	627
	その他	119,987	121,147	9,598	9,691
4	カウンターパーティ信用リスク	118,029	117,372	9,605	9,551
5	うち、SA-CCR適用分	32,695	32,839	2,772	2,784
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,851	83,287	6,708	6,663
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	294	400	23	32
	その他	1,188	844	100	71
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	254,873	261,566	21,613	22,180
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)	1,000,997	989,849	84,809	83,864
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)	61,473	27,603	4,917	2,208
	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%)	1,233	1,302	98	104
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	144,720	140,844	11,577	11,267
17	うち、標準的方式適用分	144,720	140,844	11,577	11,267
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	305,777	24,462	24,462
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	305,777	24,462	24,462
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	33,219	33,153	2,816	2,811
	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	1,168,097	1,103,948	93,447	88,315
25	合計	8,072,265	7,961,861	675,016	666,182

(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	4,926,154	4,927,219	417,045	417,151
2	うち、標準的手法適用分	24,797	20,204	1,983	1,616
3	うち、内部格付手法適用分	4,781,810	4,786,323	405,497	405,880
	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	119,546	120,690	9,563	9,655
4	カウンターパーティ信用リスク	118,029	117,372	9,605	9,551
5	うち、SA-CCR適用分	32,695	32,839	2,772	2,784
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	83,851	83,287	6,708	6,663
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	294	400	23	32
	その他	1,188	844	100	71
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	189,397	189,667	16,060	16,083
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)	1,000,997	989,849	84,809	83,864
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)	61,473	27,603	4,917	2,208
	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%)	1,233	1,302	98	104
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	143,009	139,809	11,440	11,184
17	うち、標準的方式適用分	143,009	139,809	11,440	11,184
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	287,525	23,002	23,002
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	287,525	23,002	23,002
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	12,249	12,028	1,038	1,020
24	フロア調整	1,062,268	1,005,635	84,981	80,450
25	合計	7,802,338	7,698,012	653,000	644,622

(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。