

リスク・アセットの概要

(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		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	2,077,719	1,999,875
2	うち、標準的手法適用分	7,891	10,028	631	802
3	うち、内部格付手法適用分	2,010,868	1,927,245	170,602	163,520
	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	58,959	62,601	4,716	5,008
4	カウンターパーティー信用リスク	80,185	37,774	6,695	3,110
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	16,647	16,882	1,411	1,431
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	21,493	19,119	1,719	1,529
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	302	307	24	24
	その他	41,742	1,464	3,539	124
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	51	48	4	4
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)	259,231	424,405	20,670	33,891
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)	4,971	6,316	157	258
	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%)	-	1,091	-	-
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	3,936	3,872	314	309
13	うち、内部格付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	3,774	3,872	301	309
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	162	-	13	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
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	99,580	90,871	7,966	7,269
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	99,580	90,871	7,966	7,269
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	23,147	33,856	1,962	2,871
	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	2,548,823	2,598,113	213,722	217,046

(注) 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。