

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		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	3,833,312	3,747,196	324,502	317,173
2	うち、標準的手法適用分	34,817	38,622	2,785	3,089
3	うち、内部格付手法適用分	3,655,303	3,575,629	310,261	303,448
	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	1,268	1,254	101	100
	その他	141,923	131,690	11,353	10,535
4	カウンターパーティー信用リスク	52,883	46,196	4,357	3,811
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	19,777	19,497	1,677	1,653
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	26,163	21,780	2,093	1,742
	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	6,640	4,610	563	391
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	54,973	30,332	4,661	2,572
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)	349,351	554,296	27,853	44,263
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)	24,602	46,118	1,568	3,348
	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%)	25,654	14,511	2,052	987
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	25,841	26,089	2,067	2,087
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	19,494	19,679	1,559	1,574
14	うち、外部格付準拠方式適用分	5,829	5,951	466	476
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	287	-	22	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	230	458	18	36
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	194,401	183,577	15,552	14,686
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	194,401	183,577	15,552	14,686
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	66,063	79,348	5,602	6,728
	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	4,627,085	4,727,666	388,217	395,658

(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。