

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(単体) | | | | | |
|---------------------|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 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 | |
| | | 当期末 (2020年3月末) | 前期末 (2019年3月末) | 当期末 (2020年3月末) | 前期末 (2019年3月末) |
| 1 | 信用リスク | 7,414,344 | 7,052,861 | 593,147 | 564,228 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 7,372,965 | 7,013,020 | 589,837 | 561,041 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | - | - | - | - |
| | 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 | 41,378 | 39,840 | 3,310 | 3,187 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 109,955 | 104,911 | 8,796 | 8,392 |
| 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 | 67,190 | 66,631 | 5,375 | 5,330 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 41,991 | 37,906 | 3,359 | 3,032 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 773 | 373 | 61 | 29 |
| | その他 | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |
| 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) | 32,219 | 26,493 | 2,577 | 2,119 |
| 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) | 625 | - | 50 | - |
| | 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%) | - | - | - | - |
| 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 | 2,427 | 2,885 | 194 | 230 |
| 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 | 2,427 | 2,885 | 194 | 230 |
| | 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 | 203,778 | 224,286 | 16,302 | 17,942 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 203,778 | 224,286 | 16,302 | 17,942 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | - | - | - | - |
| 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 | 130,730 | 119,527 | 10,458 | 9,562 |
| | 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 | 7,894,080 | 7,530,964 | 631,526 | 602,477 |

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(単体) | | | | | |
|---------------------|--|---------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| 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 | |
| | | 当四半期末 (2020年3月末) | 前四半期末 (2019年12月末) | 当四半期末 (2020年3月末) | 前四半期末 (2019年12月末) |
| 1 | 信用リスク | 7,414,344 | 7,350,669 | 593,147 | 588,053 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 7,372,965 | 7,310,026 | 589,837 | 584,802 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | - | - | - | - |
| | 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 | 41,378 | 40,643 | 3,310 | 3,251 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 109,955 | 102,822 | 8,796 | 8,225 |
| 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 | 67,190 | 63,836 | 5,375 | 5,106 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | - | - | - | - |
| | うち、CVAリスク | 41,991 | 38,352 | 3,359 | 3,068 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 773 | 631 | 61 | 50 |
| | その他 | - | 1 | - | 0 |
| 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 | - | - | - | - |
| 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) | 32,219 | 19,021 | 2,577 | 1,521 |
| 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) | 625 | - | 50 | - |
| | 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%) | - | 2,488 | - | 199 |
| 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 | 2,427 | 2,528 | 194 | 202 |
| 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 | 2,427 | 2,528 | 194 | 202 |
| | 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 | 203,778 | 213,452 | 16,302 | 17,076 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 203,778 | 213,452 | 16,302 | 17,076 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | - | - | - | - |
| 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 | 130,730 | 111,105 | 10,458 | 8,888 |
| | 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 | 7,894,080 | 7,802,089 | 631,526 | 624,167 |