

連結リスク・アセットの概要
(2020年3月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(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	
		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	3,246,407	3,219,193	274,502	272,215
2	うち、標準的手法適用分	96,759	92,350	7,740	7,388
3	うち、内部格付手法適用分	3,081,294	3,058,248	261,293	259,339
	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	68,353	68,594	5,468	5,487
4	カウンターパーティ信用リスク	31,154	29,035	2,568	2,391
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	13,120	12,480	1,112	1,058
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	15,367	14,615	1,229	1,169
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24	23	1	1
	その他	2,641	1,917	223	162
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	261,991	264,646	22,216	22,441
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)	276,449	308,108	23,442	26,127
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 (マンドレート方式)	32,977	34,510	2,796	2,926
	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	21	26	1	2
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	21	26	1	2
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	-	-	-	-
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	160,099	163,938	12,807	13,115
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	160,099	163,938	12,807	13,115
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	2,732	2,552	231	216
	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	4,011,833	4,022,011	338,568	339,436