

連結リスク・アセットの概要
(2020年6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6月末)	前四半期末 (2020年3月末)	当四半期末 (2020年6月末)	前四半期末 (2020年3月末)
1	信用リスク	3,254,733	3,246,407	275,198	274,502
2	うち、標準的手法適用分	99,158	96,759	7,932	7,740
3	うち、内部格付手法適用分	3,087,520	3,081,294	261,821	261,293
	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	68,053	68,353	5,444	5,468
4	カウンターパーティ信用リスク	28,347	31,154	2,336	2,568
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	12,117	13,120	1,027	1,112
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	14,056	15,367	1,124	1,229
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	24	24	1	1
	その他	2,148	2,641	182	223
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	245,234	261,991	20,795	22,216
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)	204,874	276,449	17,373	23,442
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nderト方式)	40,230	32,977	3,411	2,796
	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	17	21	1	1
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	17	21	1	1
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	160,099	12,807	12,807
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	160,099	12,807	12,807
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	2,647	2,732	224	231
	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	3,936,184	4,011,833	332,149	338,568