

連結リスク・アセットの概要
(2020年9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9月末)	前四半期末 (2020年6月末)	当四半期末 (2020年9月末)	前四半期末 (2020年6月末)
1	信用リスク	3,262,954	3,254,733	275,905	275,198
2	うち、標準的手法適用分	97,280	99,158	7,782	7,932
3	うち、内部格付手法適用分	3,097,811	3,087,520	262,694	261,821
	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	67,861	68,053	5,428	5,444
4	カウンターパーティ信用リスク	31,343	28,347	2,579	2,336
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	13,176	12,117	1,117	1,027
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,307	14,056	1,304	1,124
	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	1,833	2,148	155	182
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	339,037	245,234	28,750	20,795
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)	211,485	204,874	17,933	17,373
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)	40,219	40,230	3,410	3,411
	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	435	17	34	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	435	17	34	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	155,528	160,099	12,442	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	155,528	160,099	12,442	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	2,603	2,647	220	224
	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	4,043,607	3,936,184	341,278	332,149