

単体リスク・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	3,214,937	3,209,361	272,217	271,723
2	うち、標準的手法適用分	20,661	24,987	1,652	1,998
3	うち、内部格付手法適用分	3,129,755	3,119,689	265,403	264,549
	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	64,520	64,684	5,161	5,174
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	336,457	242,859	28,531	20,594
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)	212,258	205,665	17,999	17,440
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	146,109	150,913	11,688	12,073
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,109	150,913	11,688	12,073
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	3,734	3,774	316	320
	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	3,985,494	3,881,170	336,779	327,900