

**連結リスク・アセットの概要**  
(2020年12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12月末)	前四半期末 (2020年9月末)	当四半期末 (2020年12月末)	前四半期末 (2020年9月末)
1	信用リスク	3,265,799	3,262,954	276,178	275,905
2	うち、標準的手法適用分	90,617	97,280	7,249	7,782
3	うち、内部格付手法適用分	3,107,234	3,097,811	263,493	262,694
	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	67,948	67,861	5,435	5,428
4	カウンターパーティ信用リスク	33,536	31,343	2,761	2,579
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	14,111	13,176	1,196	1,117
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,174	16,307	1,373	1,304
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	25	24	2	1
	その他	2,224	1,833	188	155
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	376,546	339,037	31,931	28,750
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)	199,875	211,485	16,949	17,933
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)	45,309	40,219	3,842	3,410
	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	424	435	33	34
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	424	435	33	34
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	155,528	12,442	12,442
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	155,528	12,442	12,442
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	2,627	2,603	222	220
	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	4,079,648	4,043,607	344,361	341,278