

単体リスク・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	3,219,526	3,214,937	272,627	272,217
2	うち、標準的手法適用分	16,245	20,661	1,299	1,652
3	うち、内部格付手法適用分	3,138,568	3,129,755	266,150	265,403
	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	64,712	64,520	5,177	5,161
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	373,749	336,457	31,693	28,531
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)	200,665	212,258	17,016	17,999
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	146,109	146,109	11,688	11,688
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	146,109	11,688	11,688
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	3,735	3,734	316	316
	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	4,023,055	3,985,494	339,980	336,779