

連結リスク・アセットの概要
(2021年3月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(単位：百万円)

国際様式の 該当番号			イ	ロ	ハ	ニ
			リスク・アセット		所要自己資本	
			当四半期末 (2021年3月末)	前四半期末 (2020年12月末)	当四半期末 (2021年3月末)	前四半期末 (2020年12月末)
OV1：リスク・アセットの概要						
1		信用リスク	3,261,613	3,265,799	275,816	276,178
2		うち、標準的手法適用分	90,594	90,617	7,247	7,249
3		うち、内部格付手法適用分	3,101,559	3,107,234	263,012	263,493
		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	69,459	67,948	5,556	5,435
4		カウンターパーティ信用リスク	37,670	33,536	3,112	2,761
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	13,943	14,111	1,182	1,196
6		うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
		うち、CVAリスク	17,127	17,174	1,370	1,373
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	26	25	2	2
		その他	6,573	2,224	557	188
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	475,585	376,546	40,329	31,931
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)	211,544	199,875	17,938	16,949
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)	49,865	45,309	4,228	3,842
		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	2,465	424	197	33
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	2,465	424	197	33
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	154,322	155,528	12,345	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	154,322	155,528	12,345	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	8,365	2,627	709	222
		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	4,201,432	4,079,648	354,678	344,361