

**連結リスク・アセットの概要**  
(2021年6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 (2021年6月末)	前四半期末 (2021年3月末)	当四半期末 (2021年6月末)	前四半期末 (2021年3月末)
1	信用リスク	3,201,520	3,261,613	270,678	275,816
2	うち、標準的手法適用分	99,991	90,594	7,999	7,247
3	うち、内部格付手法適用分	3,032,642	3,101,559	257,168	263,012
	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	68,886	69,459	5,510	5,556
4	カウンターパーティ信用リスク	37,096	37,670	3,063	3,112
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	14,144	13,943	1,199	1,182
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,145	17,127	1,371	1,370
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	26	26	2	2
	その他	5,779	6,573	490	557
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	460,849	475,585	39,080	40,329
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)	181,093	211,544	15,356	17,938
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)	55,505	49,865	4,706	4,228
	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	3,345	2,465	267	197
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	3,345	2,465	267	197
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	154,322	12,345	12,345
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	154,322	12,345	12,345
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	8,497	8,365	720	709
	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	4,102,231	4,201,432	346,219	354,678