

単体リスク・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	3,153,990	3,214,630
2	うち、標準的手法適用分	25,075	15,831	2,006	1,266
3	うち、内部格付手法適用分	3,063,280	3,132,590	259,766	265,643
	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	65,634	66,209	5,250	5,296
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	458,472	473,077	38,878	40,116
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)	181,809	212,259	15,417	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)	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	145,051	145,051	11,604	11,604
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	145,051	145,051	11,604	11,604
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	9,446	9,349	801	792
	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	4,044,717	4,144,369	341,761	350,258