

連結リスク・アセットの概要
(2021年9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9月末)	前四半期末 (2021年6月末)	当四半期末 (2021年9月末)	前四半期末 (2021年6月末)
1	信用リスク	3,168,957	3,201,520	267,960	270,678
2	うち、標準的手法適用分	91,344	99,991	7,307	7,999
3	うち、内部格付手法適用分	3,009,218	3,032,642	255,181	257,168
	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	68,394	68,886	5,471	5,510
4	カウンターパーティ信用リスク	36,730	37,096	3,031	3,063
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	14,144	1,199	1,199
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,286	17,145	1,382	1,371
	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	5,273	5,779	447	490
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	504,604	460,849	42,790	39,080
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)	185,912	181,093	15,765	15,356
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 (マドレー方式)	60,476	55,505	5,128	4,706
	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	6,640	3,345	531	267
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	6,640	3,345	531	267
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	154,017	154,322	12,321	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	154,017	154,322	12,321	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	8,334	8,497	706	720
	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	4,125,673	4,102,231	348,236	346,219