

単体リスク・アセットの概要
(2021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 (2021年12月末)	前四半期末 (2021年9月末)	当四半期末 (2021年12月末)	前四半期末 (2021年9月末)
1	信用リスク	3,093,308	3,117,354	261,924	263,962
2	うち、標準的手法適用分	17,548	15,856	1,403	1,268
3	うち、内部格付手法適用分	3,012,452	3,036,370	255,456	257,484
	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	63,307	65,126	5,064	5,210
4	カウンターパーティ信用リスク	41,555	36,730	3,431	3,031
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	15,693	14,144	1,330	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	19,219	17,286	1,537	1,382
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27	26	2	2
	その他	6,615	5,273	560	447
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	505,790	502,360	42,891	42,600
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)	173,733	186,674	14,732	15,830
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 (マંデート方式)	67,782	60,476	5,747	5,128
	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	6,825	6,640	546	531
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	6,825	6,640	546	531
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	144,305	144,305	11,544	11,544
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	144,305	144,305	11,544	11,544
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	9,276	9,276	786	786
	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	4,042,577	4,063,817	341,604	343,415