

連結リスク・アセットの概要
(2022年3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 (2022年3月末)	前四半期末 (2021年12月末)	当四半期末 (2022年3月末)	前四半期末 (2021年12月末)
1	信用リスク	3,179,155	3,143,613	268,812	265,816
2	うち、標準的手法適用分	96,243	92,165	7,699	7,373
3	うち、内部格付手法適用分	3,016,724	2,984,919	255,818	253,121
	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	66,187	66,527	5,294	5,322
4	カウンターパーティ信用リスク	43,636	41,555	3,613	3,431
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	14,823	15,693	1,257	1,330
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	18,047	19,219	1,443	1,537
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	28	27	2	2
	その他	10,737	6,615	910	560
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	506,312	508,272	42,935	43,101
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)	157,354	172,971	13,343	14,667
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)	77,693	67,782	6,588	5,747
	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	7,173	6,825	573	546
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	7,173	6,825	573	546
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	155,064	154,017	12,405	12,321
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,064	154,017	12,405	12,321
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	8,363	8,346	709	707
	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	4,134,755	4,103,386	348,982	346,340