

単体リスク・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	3,127,390	3,093,308	264,799	261,924
2	うち、標準的手法適用分	20,951	17,548	1,676	1,403
3	うち、内部格付手法適用分	3,043,482	3,012,452	258,087	255,456
	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	62,957	63,307	5,036	5,064
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	503,199	505,790	42,671	42,891
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)	158,084	173,733	13,405	14,732
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 (マデント方式)	77,678	67,782	6,587	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	144,883	144,305	11,590	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	144,883	144,305	11,590	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	9,166	9,276	777	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	4,071,213	4,042,577	344,019	341,604