

連結リスク・アセットの概要
(2022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 (2022年6月末)	前四半期末 (2022年3月末)	当四半期末 (2022年6月末)	前四半期末 (2022年3月末)
1	信用リスク	3,060,860	3,179,155	258,814	268,812
2	うち、標準的手法適用分	89,628	96,243	7,170	7,699
3	うち、内部格付手法適用分	2,905,390	3,016,724	246,377	255,818
	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	65,841	66,187	5,267	5,294
4	カウンターパーティ信用リスク	44,394	43,636	3,673	3,613
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	14,738	14,823	1,249	1,257
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	18,887	18,047	1,511	1,443
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	33	28	2	2
	その他	10,734	10,737	910	910
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	475,005	506,312	40,280	42,935
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)	144,398	157,354	12,245	13,343
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)	96,640	77,693	8,195	6,588
	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	11,873	7,173	949	573
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	11,873	7,173	949	573
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	155,064	12,405	12,405
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	155,064	12,405	12,405
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	34,905	8,363	2,959	709
	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	4,023,143	4,134,755	339,524	348,982