

単体リスク・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 | 3,008,411 | 3,127,390 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 14,898 | 20,951 | 1,191 | 1,676 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 2,930,863 | 3,043,482 | 248,537 | 258,087 |
| | 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 | 62,650 | 62,957 | 5,012 | 5,036 |
| 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 | 471,362 | 503,199 | 39,971 | 42,671 |
| 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) | 145,067 | 158,084 | 12,301 | 13,405 |
| 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) | 96,583 | 77,678 | 8,190 | 6,587 |
| | 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 | 144,883 | 144,883 | 11,590 | 11,590 |
| 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 | 144,883 | 11,590 | 11,590 |
| 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 | 31,977 | 9,166 | 2,711 | 777 |
| | 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 | 3,954,554 | 4,071,213 | 334,130 | 344,019 |