

連結リスク・アセットの概要
(2022年9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9月末)	前四半期末 (2022年6月末)	当四半期末 (2022年9月末)	前四半期末 (2022年6月末)
1	信用リスク	2,990,953	3,060,860	252,913	258,814
2	うち、標準的手法適用分	84,084	89,628	6,726	7,170
3	うち、内部格付手法適用分	2,841,148	2,905,390	240,929	246,377
	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	65,721	65,841	5,257	5,267
4	カウンターパーティ信用リスク	45,842	44,394	3,784	3,673
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	14,111	14,738	1,196	1,249
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	21,336	18,887	1,706	1,511
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32	33	2	2
	その他	10,360	10,734	878	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	428,593	475,005	36,344	40,280
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)	139,202	144,398	11,804	12,245
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)	103,270	96,640	8,757	8,195
	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	14,310	11,873	1,144	949
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	14,310	11,873	1,144	949
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	157,383	155,064	12,590	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	157,383	155,064	12,590	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	51,379	34,905	4,356	2,959
	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	3,930,936	4,023,143	331,697	339,524