

単体リスク・アセットの概要
(2022年12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12月末)	前四半期末 (2022年9月末)	当四半期末 (2022年12月末)	前四半期末 (2022年9月末)
1	信用リスク	2,949,163	2,935,574	249,742	248,594
2	うち、標準的手法適用分	9,985	8,746	798	699
3	うち、内部格付手法適用分	2,877,061	2,864,278	243,974	242,890
	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	62,115	62,549	4,969	5,003
4	カウンターパーティ信用リスク	48,997	45,842	4,030	3,784
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	18,637	14,111	1,580	1,196
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	25,803	21,336	2,064	1,706
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	40	32	3	2
	その他	4,516	10,360	383	878
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	420,772	422,878	35,681	35,860
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)	141,361	139,761	11,987	11,851
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)	96,513	103,149	8,184	8,747
	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	14,062	14,310	1,125	1,144
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	14,062	14,310	1,125	1,144
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	146,868	146,868	11,749	11,749
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,868	146,868	11,749	11,749
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	67,698	48,324	5,740	4,097
	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	3,885,438	3,856,710	328,242	325,830