

連結リスク・アセットの概要
(2023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 (2023年3月末)	前四半期末 (2022年12月末)	当四半期末 (2023年3月末)	前四半期末 (2022年12月末)
1	信用リスク	3,334,827		266,786	
2	うち、標準的手法適用分	762,818		61,025	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,452,217		196,177	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	54,603		4,368	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-		-	
	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	65,188		5,215	
6	カウンターパーティ信用リスク	16,382		1,310	
7	うち、SA-CCR適用分	10,246		819	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	34		2	
9	その他	6,101		488	
10	CVAリスク	20,350		1,628	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	20,350		1,628	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-		-	
12	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)	116,163		9,293	
13	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 (マンドレート方式)	56,945		4,555	
	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%)	-		-	
14	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%)	-		-	
15	未決済取引	-		-	
16	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	14,263		1,141	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	14,263		1,141	
19	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	-		-	
20	マーケット・リスク	-		-	
21	うち、標準的方式適用分	-		-	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	-		-	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	233,175		18,654	
25	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	42,517		3,401	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	3,834,627		306,770	

※2023年3月末より、改正後の別紙様式(令和4年金融庁告示第24号)に基づき作成を行っているため、前四半期末は空欄としております。