

単体リスク・アセットの概要
(2023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					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2023年6月末)	前四半期末 (2023年3月末)	当四半期末 (2023年6月末)	前四半期末 (2023年3月末)
1	信用リスク	3,165,112	3,283,587	253,208	262,687
2	うち、標準的手法適用分	529,813	699,312	42,385	55,945
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,507,635	2,467,907	200,610	197,432
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	66,017	54,603	5,281	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	61,644	61,764	4,931	4,941
6	カウンターパーティ信用リスク	18,021	16,382	1,441	1,310
7	うち、SA-CCR適用分	8,073	10,246	645	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	32	34	2	2
9	その他	9,914	6,101	793	488
10	CVAリスク	15,396	20,350	1,231	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	15,396	20,350	1,231	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)	115,158	116,533	9,212	9,322
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 (マंडレート方式)	60,825	56,945	4,866	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25%)	-	-	-	-
	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40%)	-	-	-	-
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125%)	-	-	-	-
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	15,554	14,263	1,244	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	15,554	14,263	1,244	1,141
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、125%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	170,961	170,961	13,676	13,676
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	24,456	39,024	1,956	3,121
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,585,485	3,718,049	286,838	297,443