

連結リスク・アセットの概要  
(2023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 (2023年9月末)	前四半期末 (2023年6月末)	当四半期末 (2023年9月末)	前四半期末 (2023年6月末)
1	信用リスク	3,405,142	3,218,774	272,411	257,501
2	うち、標準的手法適用分	785,385	595,533	62,830	47,642
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,473,751	2,492,074	197,900	199,365
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	80,983	66,017	6,478	5,281
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	65,021	65,148	5,201	5,211
6	カウンターパーティ信用リスク	17,780	18,021	1,422	1,441
7	うち、SA-CCR適用分	8,974	8,073	717	645
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	44	32	3	2
9	その他	8,761	9,914	700	793
10	CVAリスク	17,732	15,396	1,418	1,231
	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	17,732	15,396	1,418	1,231
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)	99,280	114,789	7,942	9,183
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 (マンドート方式)	71,571	60,825	5,725	4,866
	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	17,062	15,554	1,364	1,244
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	17,062	15,554	1,364	1,244
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	226,561	233,175	18,124	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	46,258	28,301	3,700	2,264
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,901,390	3,704,838	312,111	296,387