

単体リスク・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	3,349,743	3,165,112	267,979	253,208
2	うち、標準的手法適用分	718,418	529,813	57,473	42,385
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,488,840	2,507,635	199,107	200,610
4	うち、スロットティング・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	61,500	61,644	4,920	4,931
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)	99,634	115,158	7,970	9,212
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	164,516	170,961	13,161	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	42,355	24,456	3,388	1,956
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,780,397	3,585,485	302,431	286,838