

連結リスク・アセットの概要  
(2023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 (2023年12月末)	前四半期末 (2023年9月末)	当四半期末 (2023年12月末)	前四半期末 (2023年9月末)
1	信用リスク	3,154,859	3,405,142	252,388	272,411
2	うち、標準的手法適用分	635,012	785,385	50,800	62,830
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,366,820	2,473,751	189,345	197,900
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	87,375	80,983	6,990	6,478
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	65,651	65,021	5,252	5,201
6	カウンターパーティ信用リスク	20,018	17,780	1,601	1,422
7	うち、SA-CCR適用分	10,258	8,974	820	717
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	39	44	3	3
9	その他	9,720	8,761	777	700
10	CVAリスク	19,987	17,732	1,598	1,418
	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	19,987	17,732	1,598	1,418
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)	104,014	99,280	8,321	7,942
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)	69,383	71,571	5,550	5,725
	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	15,380	17,062	1,230	1,364
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	15,380	17,062	1,230	1,364
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	226,561	226,561	18,124	18,124
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	33,239	46,258	2,659	3,700
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,643,445	3,901,390	291,475	312,111