

単体リスク・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 | 3,099,453 | 3,349,743 | 247,956 | 267,979 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 567,685 | 718,418 | 45,414 | 57,473 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 2,382,350 | 2,488,840 | 190,588 | 199,107 |
| 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 | 62,043 | 61,500 | 4,963 | 4,920 |
| 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) | 104,368 | 99,634 | 8,349 | 7,970 |
| 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 | 164,516 | 164,516 | 13,161 | 13,161 |
| 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 | 28,965 | 42,355 | 2,317 | 3,388 |
| 26 | フロア調整 | - | - | - | - |
| 27 | 合計 | 3,522,074 | 3,780,397 | 281,765 | 302,431 |