

リスク・アセットの概要

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要		リスク・アセット		所定自己資本	
国際様式の 該当番号		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	2,040,204	2,000,687	163,216	160,055
2	うち、標準的手法適用分	13,034	9,973	1,042	797
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,827,473	1,769,270	146,197	141,541
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	164,405	167,119	13,152	13,369
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	35,291	54,323	2,823	4,345
6	カウンターパーティー信用リスク	31,497	27,036	2,519	2,162
7	うち、SA-CCR適用分	16,499	19,466	1,319	1,557
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	529	584	42	46
9	その他	14,468	6,984	1,157	558
10	CVAリスク	31,267	36,162	2,501	2,893
	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	31,267	36,162	2,501	2,893
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	143,858	83,344	11,508	6,667
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)	179,624	181,886	14,369	14,550
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)	31,097	25,020	2,487	2,001
	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	5,675	5,819	454	465
17	うち、内部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	5,078	5,211	406	416
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	596	608	47	48
	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	67,114	67,114	5,369	5,369
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	8	5,580	0	446
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,530,347	2,432,652	202,427	194,612