

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  |           | 所要自己資本   |          |
|-----------------|--|-----------|-----------|----------|----------|
| 国際様式の<br>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  | 3,729,784 | 3,676,970 | 298,382  | 294,157  |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | 56,938    | 43,858    | 4,555    | 3,508    |
| 3               | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 3,400,594 | 3,320,033 | 272,047  | 265,602  |
| 4               | うち、スロッシング・クライテリア適用分                              | 200,077   | 198,340   | 16,006   | 15,867   |
| 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                      | 1,168     | 1,181     | 93       | 94       |
|                 | その他  | 71,004    | 113,556   | 5,680    | 9,084    |
| 6               | カウンターパーティー信用リスク                                  | 44,550    | 33,757    | 3,564    | 2,700    |
| 7               | うち、SA-CGR適用分                                     | 23,488    | 20,890    | 1,879    | 1,671    |
| 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  | 20,532    | 12,282    | 1,642    | 982      |
| 10              | CVAリスク   | 45,040    | 46,088    | 3,603    | 3,687    |
|                 | 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                                 | 45,040    | 46,088    | 3,603    | 3,687    |
| 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           | 283,099   | 164,849   | 22,647   | 13,187   |
| 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)      | 269,694   | 263,702   | 21,575   | 21,096   |
| 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)        | 43,713    | 36,690    | 3,497    | 2,935    |
|                 | 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               | 23,555    | 23,603    | 1,884    | 1,888    |
| 17              | うち、内部格付準拠方式適用分                                   | 16,414    | 16,445    | 1,313    | 1,315    |
| 18              | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                           | 6,299     | 6,448     | 503      | 515      |
| 19              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 739       | 608       | 59       | 48       |
|                 | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | 101       | 102       | 8        | 8        |
| 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                                     | 138,138   | 138,138   | 11,051   | 11,051   |
| 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                 | 18,798    | 35,290    | 1,503    | 2,823    |
| 26              | フロア調整  | -         | -         | -        | -        |
| 27              | 合計   | 4,596,376 | 4,419,091 | 367,710  | 353,527  |