

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					
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所定自己資本	
		2023年9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	2,089,563	2,040,204	167,165	163,216
2	うち、標準的手法適用分	10,559	13,034	844	1,042
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,863,689	1,827,473	149,095	146,197
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	173,231	164,405	13,858	13,152
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	42,082	35,291	3,366	2,823
6	カウンターパーティー信用リスク	32,929	31,497	2,634	2,519
7	うち、SA-CCR適用分	18,388	16,499	1,471	1,319
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	665	529	53	42
9	その他	13,876	14,468	1,110	1,157
10	CVAリスク	38,274	31,267	3,061	2,501
	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	38,274	31,267	3,061	2,501
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	176,950	143,858	14,156	11,508
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)	198,996	179,624	15,919	14,369
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)	32,296	31,097	2,583	2,487
	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	5,851	5,675	468	454
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	5,122	5,078	409	406
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	728	596	58	47
	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	69,124	67,114	5,529	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	6,714	8	537	0
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,650,701	2,530,347	212,056	202,427