

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		所要自己資本	
		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	3,768,207	3,729,784	301,456	298,382
2	うち、標準的手法適用分	50,408	56,938	4,032	4,555
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,436,692	3,400,594	274,935	272,047
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	207,900	200,077	16,632	16,006
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	1,201	1,168	96	93
	その他	72,003	71,004	5,760	5,680
6	カウンターパーティー信用リスク	43,419	44,550	3,473	3,564
7	うち、SA-CGR適用分	25,260	23,468	2,020	1,879
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	17,493	20,532	1,399	1,642
10	CVAリスク	51,222	45,040	4,097	3,603
	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	51,222	45,040	4,097	3,603
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	352,864	283,099	28,229	22,647
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)	291,997	269,694	23,359	21,575
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(マシメント方式)	44,599	43,713	3,567	3,497
	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	24,119	23,555	1,929	1,884
17	うち、内部格付準拠方式適用分	16,711	16,414	1,336	1,313
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,334	6,299	506	503
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	971	739	77	59
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	101	101	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	143,381	138,138	11,470	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	35,670	18,798	2,853	1,503
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,755,481	4,596,376	380,438	367,710