

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12月末	2023年9月末	2023年12月末	2023年9月末
1	信用リスク	2,113,535	2,089,563	169,082	167,165
2	うち、標準的手法適用分	16,325	10,559	1,306	844
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,873,344	1,863,689	149,867	149,095
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	186,396	173,231	14,911	13,858
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	37,469	42,082	2,997	3,366
6	カウンターパーティー信用リスク	28,859	32,929	2,148	2,634
7	うち、SA-CCR適用分	20,187	18,388	1,615	1,471
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	485	665	38	53
9	その他	6,185	13,876	494	1,110
10	CVAリスク	39,203	38,274	3,136	3,061
	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	39,203	38,274	3,136	3,061
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	237,481	176,950	18,998	14,156
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)	231,895	198,996	18,551	15,919
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)	31,482	32,296	2,518	2,583
	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	6,450	5,851	516	468
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	5,427	5,122	434	409
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,023	728	81	58
	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	69,124	5,529	5,529
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	1,878	6,714	150	537
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,757,910	2,650,701	220,632	212,056