

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 該当番号		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	3,790,772	3,768,207	303,261	301,456
2	うち、標準的手法適用分	58,102	50,408	4,648	4,032
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,438,595	3,436,692	275,087	274,935
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	220,512	207,900	17,641	16,632
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	1,218	1,201	97	96
	その他	72,343	72,003	5,787	5,760
6	カウンターパーティー信用リスク	36,808	43,419	2,944	3,473
7	うち、SA-CGR適用分	26,426	25,260	2,114	2,020
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	502	665	40	53
9	その他	9,879	17,493	790	1,399
10	CVAリスク	48,696	51,222	3,895	4,097
	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	48,696	51,222	3,895	4,097
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	426,976	352,864	34,158	28,229
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)	341,084	291,997	27,286	23,359
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)	42,702	44,599	3,416	3,567
	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	24,159	24,119	1,932	1,929
17	うち、内部格付準拠方式適用分	16,162	16,711	1,293	1,336
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,629	6,334	530	506
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,265	971	101	77
	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	143,381	11,470	11,470
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	25,595	35,670	2,047	2,853
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,880,176	4,755,481	390,414	380,438