

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年6月末)

連結

(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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2023/6)	前四半期末 (2023/3)	当四半期末 (2023/6)	前四半期末 (2023/3)
1	信用リスク	2,184,589	2,184,758	174,767	174,780
2	うち、標準的手法適用分	2,129,294	2,130,612	170,343	170,449
3	うち、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	55,295	54,146	4,423	4,331
4	カウンターパーティ信用リスク	4,141	3,682	331	294
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	864	883	69	70
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	2,580	2,041	206	163
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	695	757	55	60
7	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	-	-	-	-
8	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)	78,570	74,793	6,285	5,983
9	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)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
10	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%)	-	-	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	18,403	18,090	1,472	1,447
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,697	13,872	1,015	1,109
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,706	4,218	456	337
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク				
17	うち、標準的方式適用分				
18	うち、内部モデル方式適用分				
19	オペレーショナル・リスク	76,560	76,560	6,124	6,124
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	76,560	76,560	6,124	6,124
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	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	-	-	-	-
	経過措置によりリスクアセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整				
25	合計	2,362,265	2,357,885	188,981	188,630

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年6月末)

単体

(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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2023/6)	前四半期末 (2023/3)	当四半期末 (2023/6)	前四半期末 (2023/3)
1	信用リスク	2,150,345	2,147,331	172,027	171,786
2	うち、標準的手法適用分	2,109,887	2,108,244	168,791	168,659
3	うち、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	40,458	39,087	3,236	3,127
4	カウンターパーティ信用リスク	4,141	3,682	331	294
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	864	883	69	70
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	2,580	2,041	206	163
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	695	757	55	60
7	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	-	-	-	-
8	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)	78,548	74,771	6,283	5,981
9	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(マデデート方式)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
10	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%)	-	-	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	18,403	18,090	1,472	1,447
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	12,697	13,872	1,015	1,109
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,706	4,218	456	337
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク				
17	うち、標準的方式適用分				
18	うち、内部モデル方式適用分				
19	オペレーショナル・リスク	71,169	71,169	5,693	5,693
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	71,169	71,169	5,693	5,693
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	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	-	-	-	-
	経過措置によりリスクアセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整				
25	合計	2,322,609	2,315,046	185,808	185,203