

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年9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 (2023/9)	前四半期末 (2023/6)	当四半期末 (2023/9)	前四半期末 (2023/6)
1	信用リスク	2,204,732	2,184,589	176,378	174,767
2	うち、標準的手法適用分	2,149,305	2,129,294	171,944	170,343
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	55,426	55,295	4,434	4,423
4	カウンターパーティ信用リスク	7,790	4,141	623	331
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	1,391	864	111	69
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	5,920	2,580	473	206
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	478	695	38	55
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)	81,915	78,570	6,553	6,285
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	21,614	18,403	1,729	1,472
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	16,923	12,697	1,353	1,015
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,690	5,706	375	456
	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	78,813	76,560	6,305	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	78,813	76,560	6,305	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	2,394,867	2,362,265	191,589	188,981

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年9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 (2023/9)	前四半期末 (2023/6)	当四半期末 (2023/9)	前四半期末 (2023/6)
1	信用リスク	2,169,354	2,150,345	173,548	172,027
2	うち、標準的手法適用分	2,129,189	2,109,887	170,335	168,791
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	40,164	40,458	3,213	3,236
4	カウンターパーティ信用リスク	7,790	4,141	623	331
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	1,391	864	111	69
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	5,920	2,580	473	206
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	478	695	38	55
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)	81,888	78,548	6,551	6,283
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(マデット方式)	—	—	—	—
	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	21,614	18,403	1,729	1,472
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	16,923	12,697	1,353	1,015
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,690	5,706	375	456
	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	73,425	71,169	5,874	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	73,425	71,169	5,874	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	2,354,074	2,322,609	188,325	185,808