

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年12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 (2023/12)	前四半期末 (2023/9)	当四半期末 (2023/12)	前四半期末 (2023/9)
1	信用リスク	2,213,276	2,204,732	177,062	176,378
2	うち、標準的手法適用分	2,156,033	2,149,305	172,482	171,944
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	57,243	55,426	4,579	4,434
4	カウンターパーティ信用リスク	8,296	7,790	663	623
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	1,680	1,391	134	111
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,196	5,920	495	473
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	419	478	33	38
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)	89,440	81,915	7,155	6,553
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	22,681	21,614	1,814	1,729
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	17,636	16,923	1,410	1,353
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,045	4,690	403	375
	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	78,813	6,305	6,305
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	78,813	6,305	6,305
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	2,412,508	2,394,867	193,000	191,589

■OV1:リスク・アセットの概要 (2023年12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 (2023/12)	前四半期末 (2023/9)	当四半期末 (2023/12)	前四半期末 (2023/9)
1	信用リスク	2,176,895	2,169,354	174,151	173,548
2	うち、標準的手法適用分	2,137,049	2,129,189	170,963	170,335
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	39,845	40,164	3,187	3,213
4	カウンターパーティ信用リスク	8,296	7,790	663	623
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	1,680	1,391	134	111
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,196	5,920	495	473
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	419	478	33	38
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)	89,412	81,888	7,153	6,551
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	22,681	21,614	1,814	1,729
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	17,636	16,923	1,410	1,353
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,045	4,690	403	375
	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	73,425	5,874	5,874
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	73,425	5,874	5,874
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	2,370,711	2,354,074	189,656	188,325