

リスク・アセットの概要（2023年12月末）

【連結】

(単位:百万円)

OVI:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		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	5,454,793	5,392,435	461,550	456,293
2	うち、標準的手法適用分	84,615	78,285	6,769	6,262
3	うち、内部格付手法適用分	5,243,137	5,187,148	444,618	439,870
	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	9,918	9,652	793	772
	その他	117,122	117,348	9,369	9,387
4	カウンターパーティ信用リスク	122,991	140,527	10,000	11,411
5	うち、SA-CCR適用分	29,196	32,694	2,475	2,772
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	88,029	103,751	7,042	8,300
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,385	1,517	110	121
	その他	4,379	2,564	371	217
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	290,162	307,603	24,605	26,084
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)	997,477	1,042,296	84,499	88,314
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)	102,723	121,293	8,217	9,703
	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%)	1,722	4,122	137	329
11	未決済取引	0	-	0	-
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	160,388	140,136	12,831	11,210
17	うち、標準的方式適用分	160,388	140,136	12,831	11,210
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	329,318	329,318	26,345	26,345
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	329,318	329,318	26,345	26,345
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	40,528	39,559	3,436	3,354
	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	1,342,815	1,194,220	107,425	95,537
25	合計	8,842,921	8,711,514	739,050	728,585

(注) 1. 「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。

【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	
		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	5,434,915	5,349,605	460,042	452,951
2	うち、標準的手法適用分	58,107	27,900	4,648	2,232
3	うち、内部格付手法適用分	5,260,189	5,204,806	446,064	441,367
	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	116,617	116,898	9,329	9,351
4	カウンターパーティ信用リスク	122,991	140,527	10,000	11,411
5	うち、SA-CCR適用分	29,196	32,694	2,475	2,772
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	88,029	103,751	7,042	8,300
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,385	1,517	110	121
	その他	4,379	2,564	371	217
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	209,845	225,627	17,794	19,133
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)	997,477	1,042,296	84,499	88,314
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)	102,723	121,293	8,217	9,703
	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%)	1,722	4,122	137	329
11	未決済取引	0	-	0	-
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	-	-	-	-
13	うち、内部格付手法標準方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付手法標準方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法標準方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	158,849	138,788	12,707	11,103
17	うち、標準的方式適用分	158,849	138,788	12,707	11,103
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	314,634	314,634	25,170	25,170
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	314,634	314,634	25,170	25,170
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	17,061	16,184	1,446	1,372
	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	1,167,402	1,029,884	93,392	82,390
25	合計	8,527,623	8,382,966	713,410	701,880

(注) 1.「国際様式の該当番号」とは、パーセル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2.内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。