

リスク・アセットの概要（2023年12月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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	4,227,120	4,227,995
2	うち、標準的手法適用分	131,561	128,054	10,524	10,244
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,730,010	3,743,324	298,400	299,465
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	261,398	261,866	20,911	20,949
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	-	-	-	-
	その他	104,148	94,749	8,331	7,579
6	カウンターパーティ信用リスク	43,086	43,237	3,446	3,459
7	うち、SA-CCR適用分	39,250	40,179	3,140	3,214
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	358	1,297	28	103
9	その他	3,477	1,761	278	140
10	CVAリスク	160,707	169,184	12,856	13,534
	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	160,707	169,184	12,856	13,534
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	112,765	111,500	9,021	8,920
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）	525,409	544,893	42,032	43,591
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（マンドート方式）	42,877	45,573	3,430	3,645
	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	77,395	81,344	6,191	6,507
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,395	81,344	6,191	6,507
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	458	1,641	36	131
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	458	1,641	36	131
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	181,855	181,855	14,548	14,548
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	64,898	63,950	5,191	5,116
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,436,574	5,471,176	434,925	437,694

リスク・アセットの概要（2023年12月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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	4,107,028	4,111,531	328,562	328,922
2	うち、標準的手法適用分	8,561	7,910	684	632
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,741,026	3,754,818	299,282	300,385
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	261,398	261,866	20,911	20,949
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	-	-	-	-
	その他	96,041	86,935	7,683	6,954
6	カウンターパーティ信用リスク	43,088	43,237	3,447	3,459
7	うち、SA-CCR適用分	39,252	40,179	3,140	3,214
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	358	1,297	28	103
9	その他	3,477	1,761	278	140
10	CVAリスク	160,707	169,184	12,856	13,534
	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	160,707	169,184	12,856	13,534
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	110,944	109,403	8,875	8,752
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）	537,225	556,274	42,978	44,501
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（マデート方式）	42,873	45,573	3,429	3,645
	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%）	-	1,228	-	98
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	77,395	81,344	6,191	6,507
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,395	81,344	6,191	6,507
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	332	1,601	26	128
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	332	1,601	26	128
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	177,783	177,783	14,222	14,222
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	3,294	3,290	263	263
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,260,676	5,300,454	420,854	424,036

リスク・アセットの概要（2023年12月末）

【単体】

（単位：百万円）

0V1：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	4,095,989	4,113,096	327,679	329,047
2	うち、標準的手法適用分	180	144	14	11
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,739,093	3,764,605	299,127	301,168
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	261,398	261,866	20,911	20,949
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	-	-	-	-
	その他	95,316	86,480	7,625	6,918
6	カウンターパーティ信用リスク	43,088	43,237	3,447	3,459
7	うち、SA-CCR適用分	39,252	40,179	3,140	3,214
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	358	1,297	28	103
9	その他	3,477	1,761	278	140
10	CVAリスク	160,707	169,184	12,856	13,534
	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	160,707	169,184	12,856	13,534
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	263,448	213,837	21,075	17,107
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）	536,749	555,679	42,939	44,454
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（マデート方式）	42,872	45,573	3,429	3,645
	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%）	-	1,228	-	98
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	77,395	81,344	6,191	6,507
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	77,395	81,344	6,191	6,507
19	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	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	887	1,182	70	94
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	887	1,182	70	94
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	163,066	163,066	13,045	13,045
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	940	979	75	78
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,385,147	5,388,412	430,811	431,072