

証券化エクスポージャー

- 銀行又は連結グループがオリジネーターである場合における信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャー
該当ありません。
- 銀行又は連結グループが投資家である場合における信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャー
該当ありません。
- 銀行又は連結グループがオリジネーターである場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャー
該当ありません。
- 銀行又は連結グループが投資家である場合におけるマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャー
該当ありません。

CVAリスク

●CVAリスクに関する事項

(単位：百万円)

	2022年度末	
	連結	単体
取引先共通の要素の額	2,460	2,460
取引先固有の要素の額	1,148	1,148
CVAリスク相当額を8%で除した額	13,251	13,251

(注) 1. CVAリスク相当額は、限定的なBA-CVAにより算出しております。
2. 規制改正により新設された開示事項であるため、2021年度末の計数は記載しておりません。

マーケット・リスク

●マーケット・リスクに関する事項

マーケットリスク相当額にかかる額を算入しておりません。