

単体リスク・アセットの概要
(2024年3月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(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 (2024年3月末)	前四半期末 (2023年12月末)	当四半期末 (2024年3月末)	前四半期末 (2023年12月末)
1	信用リスク	3,406,563	3,099,453	272,525	247,956
2	うち、標準的手法適用分	781,708	567,685	62,536	45,414
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,462,310	2,382,350	196,984	190,588
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	101,113	87,375	8,089	6,990
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	61,431	62,043	4,914	4,963
6	カウンターパーティ信用リスク	19,282	20,018	1,542	1,601
7	うち、SA-CCR適用分	9,038	10,258	723	820
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	38	39	3	3
9	その他	10,205	9,720	816	777
10	CVAリスク	18,105	19,987	1,448	1,598
	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	18,105	19,987	1,448	1,598
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	-	-	-	-
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)	90,330	104,368	7,226	8,349
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 (マंडレート方式)	81,091	69,383	6,487	5,550
	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25%)	-	-	-	-
	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40%)	-	-	-	-
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125%)	-	-	-	-
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	16,473	15,380	1,317	1,230
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	16,473	15,380	1,317	1,230
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、125%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
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	-	-	-	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	93,380	164,516	7,470	13,161
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	16,139	28,965	1,291	2,317
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,741,366	3,522,074	299,309	281,765