

連結リスク・アセットの概要
(2024年6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6月末)	前四半期末 (2024年3月末)	当四半期末 (2024年6月末)	前四半期末 (2024年3月末)
1	信用リスク	3,346,204	3,460,574	267,696	276,845
2	うち、標準的手法適用分	704,475	849,281	56,358	67,942
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,460,379	2,445,140	196,830	195,611
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	116,263	101,113	9,301	8,089
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	65,086	65,039	5,206	5,203
6	カウンターパーティ信用リスク	20,047	19,282	1,603	1,542
7	うち、SA-CCR適用分	9,458	9,038	756	723
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	53	38	4	3
9	その他	10,535	10,205	842	816
10	CVAリスク	18,804	18,105	1,504	1,448
	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	18,804	18,105	1,504	1,448
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)	83,616	89,954	6,689	7,196
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)	90,083	81,091	7,206	6,487
	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	16,865	16,473	1,349	1,317
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	16,865	16,473	1,349	1,317
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	132,955	132,955	10,636	10,636
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	36,569	21,682	2,925	1,734
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,745,147	3,840,120	299,611	307,209