

単体リスク・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		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	
		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	3,291,189	3,406,563	263,295	272,525
2	うち、標準的手法適用分	635,984	781,708	50,878	62,536
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,477,440	2,462,310	198,195	196,984
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	61,500	61,431	4,920	4,914
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)	83,991	90,330	6,719	7,226
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 (マンドレート方式)	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	93,380	93,380	7,470	7,470
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	31,120	16,139	2,489	1,291
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,645,484	3,741,366	291,638	299,309