

連結リスク・アセットの概要
(2024年9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9月末)	前四半期末 (2024年6月末)	当四半期末 (2024年9月末)	前四半期末 (2024年6月末)
1	信用リスク	3,464,875	3,346,204	277,190	267,696
2	うち、標準的手法適用分	818,362	704,475	65,468	56,358
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,461,524	2,460,379	196,921	196,830
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	120,156	116,263	9,612	9,301
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	64,832	65,086	5,186	5,206
6	カウンターパーティ信用リスク	26,056	20,047	2,084	1,603
7	うち、SA-CCR適用分	16,627	9,458	1,330	756
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	42	53	3	4
9	その他	9,386	10,535	750	842
10	CVAリスク	35,601	18,804	2,848	1,504
	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	35,601	18,804	2,848	1,504
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)	80,155	83,616	6,412	6,689
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)	83,118	90,083	6,649	7,206
	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	13,207	16,865	1,056	1,349
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	13,207	16,865	1,056	1,349
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	135,892	132,955	10,871	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	36,976	36,569	2,958	2,925
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,875,883	3,745,147	310,070	299,611