

単体リスク・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					
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	3,399,658	3,291,189	271,972	263,295
2	うち、標準的手法適用分	747,661	635,984	59,812	50,878
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,470,725	2,477,440	197,658	198,195
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	61,115	61,500	4,889	4,920
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)	80,542	83,991	6,443	6,719
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	96,069	93,380	7,685	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	30,745	31,120	2,459	2,489
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,764,998	3,645,484	301,199	291,638