

リスク・アセットの概要（2024年9月末）

【連結】

(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	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	5,167,086	5,207,048	413,366	416,563
2	うち、標準的手法適用分	74,671	74,883	5,973	5,990
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,691,781	4,756,746	375,342	380,539
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	271,113	247,141	21,689	19,771
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	10,579	10,227	846	818
	その他	118,939	118,048	9,515	9,443
6	カウンターパーティ信用リスク	32,419	30,609	2,593	2,448
7	うち、SA-CCR適用分	24,449	23,865	1,955	1,909
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	1,434	1,563	114	125
9	その他	6,535	5,180	522	414
10	CVAリスク	73,817	84,394	5,905	6,751
	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	73,817	84,394	5,905	6,751
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	343,106	318,955	27,448	25,516
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)	913,970	932,930	73,117	74,634
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)	93,446	85,890	7,475	6,871
	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250%)	-	-	-	-
	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400%)	-	-	-	-
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1250%)	1,353	1,279	108	102
15	未決済取引	-	1	-	0
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	79,605	93,220	6,368	7,457
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	79,605	93,220	6,368	7,457
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	225,186	222,319	18,014	17,785
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	59,678	41,759	4,774	3,340
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	6,989,669	7,018,407	559,173	561,472

【単体】

(単位:百万円)

OVI: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	
		2024年9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	5,151,448	5,193,528	412,115	415,482
2	うち、標準的手法適用分	52,774	52,194	4,221	4,175
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,709,173	4,776,685	376,733	382,134
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	271,113	247,141	21,689	19,771
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	118,386	117,506	9,470	9,400
6	カウンターパーティ信用リスク	28,543	26,876	2,283	2,150
7	うち、SA-CCR適用分	24,449	23,865	1,955	1,909
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	1,430	1,557	114	124
9	その他	2,662	1,453	212	116
10	CVAリスク	73,817	84,394	5,905	6,751
	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	73,817	84,394	5,905	6,751
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	260,415	234,650	20,833	18,772
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)	913,970	932,930	73,117	74,634
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)	93,446	85,890	7,475	6,871
	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250%)	-	-	-	-
	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400%)	-	-	-	-
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1250%)	1,353	1,279	108	102
15	未決済取引	-	1	-	0
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	79,600	93,192	6,368	7,455
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	79,600	93,192	6,368	7,455
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	199,997	198,302	15,999	15,864
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	34,683	16,831	2,774	1,346
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	6,837,276	6,867,877	546,982	549,430