

## ■OV1: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	
		当四半期末 (2024/9)	前四半期末 (2024/6)	当四半期末 (2024/9)	前四半期末 (2024/6)
1	信用リスク	2,200,656	2,281,597	176,052	182,527
2	うち、標準的手法適用分	2,142,655	2,222,119	171,412	177,769
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	—	—	—	—
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—	—	—	—
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	58,000	59,477	4,640	4,758
6	カウンターパーティ信用リスク	6,295	5,723	503	457
7	うち、SA-CCR適用分	6,295	5,719	503	457
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	—	—	—	—
9	その他	—	3	—	0
10	CVAリスク	24,463	28,366	1,957	2,269
	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	24,463	28,366	1,957	2,269
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)	73,534	69,179	5,882	5,534
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(マંデート方式)	—	—	—	—
	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%)	—	—	—	—
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	19,589	18,869	1,567	1,509
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	19,589	18,869	1,567	1,509
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	—	—	—	—
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	102,488	97,273	8,199	7,781
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	—	—	—	—
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	2,427,028	2,501,010	194,162	200,080

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2024年9月末)

単体

(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 (2024/9)	前四半期末 (2024/6)	当四半期末 (2024/9)	前四半期末 (2024/6)
1	信用リスク	2,167,137	2,248,646	173,370	179,891
2	うち、標準的手法適用分	2,124,585	2,205,015	169,966	176,401
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	—	—	—	—
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	—	—	—	—
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	42,552	43,630	3,404	3,490
6	カウンターパーティ信用リスク	6,295	5,723	503	457
7	うち、SA-CCR適用分	6,295	5,719	503	457
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	—	—	—	—
9	その他	—	3	—	0
10	CVAリスク	24,463	28,366	1,957	2,269
	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	24,463	28,366	1,957	2,269
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)	73,504	69,149	5,880	5,531
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)	—	—	—	—
	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%)	—	—	—	—
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	19,589	18,869	1,567	1,509
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	19,589	18,869	1,567	1,509
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	—	—	—	—
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	84,591	80,174	6,767	6,413
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	—	—	—	—
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	2,375,581	2,450,930	190,046	196,074