

リスク・アセットの概要

(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		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	2,022,021	2,198,100
2	うち、標準的手法適用分	85,226	90,929	6,818	7,274
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,700,238	1,860,723	136,019	148,857
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	200,932	210,379	16,074	16,830
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	35,624	36,068	2,849	2,885
6	カウンターパーティー信用リスク	28,958	30,991	2,316	2,479
7	うち、SA-CCR適用分	21,899	17,023	1,751	1,361
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	307	317	24	25
9	その他	6,750	13,651	540	1,092
10	CVAリスク	39,714	32,702	3,177	2,616
	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	39,714	32,702	3,177	2,616
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	376,747	348,351	30,139	27,868
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)	269,107	260,104	21,528	20,808
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(マンデート方式)	28,331	26,274	2,266	2,101
	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	6,113	6,212	489	496
17	うち、内部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,113	5,268	489	421
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	943	-	75
	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	74,620	67,453	5,969	5,396
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	35	38	2	3
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,845,650	2,970,230	227,652	237,618