

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		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	3,694,471	3,909,084	295,557	312,726
2	うち、標準的手法適用分	171,837	191,048	13,746	15,283
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,215,205	3,399,501	257,216	271,960
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	233,809	243,921	18,704	19,513
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	1,362	1,308	109	104
	その他	72,255	73,304	5,780	5,864
6	カウンターパーティー信用リスク	41,484	39,947	3,318	3,195
7	うち、SA-CCR適用分	31,334	22,955	2,506	1,836
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	461	430	36	34
9	その他	9,689	16,561	775	1,324
10	CVAリスク	52,070	45,884	4,165	3,670
	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	52,070	45,884	4,165	3,670
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	592,362	565,181	47,388	45,214
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)	397,302	379,309	31,784	30,344
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)	36,757	35,360	2,940	2,828
	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	22,522	23,403	1,801	1,872
17	うち、内部格付準拠方式適用分	15,252	15,466	1,220	1,237
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,929	6,652	554	532
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	240	1,184	19	94
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	100	100	8	8
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	151,757	140,473	12,140	11,237
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	25,330	21,680	2,026	1,734
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,014,058	5,160,325	401,124	412,826