

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12月末	2024年9月末	2024年12月末	2024年9月末
		1	信用リスク	2,050,758	2,022,021
2	うち、標準的手法適用分	85,941	85,226	6,875	6,818
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,710,464	1,700,238	136,837	136,019
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	216,787	200,932	17,343	16,074
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	37,563	35,624	3,005	2,849
6	カウンターパーティー信用リスク	28,373	28,958	2,269	2,316
7	うち、SA-CCR適用分	14,858	21,899	1,188	1,751
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	361	307	28	24
9	その他	13,154	6,750	1,052	540
10	CVAリスク	28,595	39,714	2,287	3,177
	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	28,595	39,714	2,287	3,177
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	377,930	376,747	30,234	30,139
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)	285,926	269,107	22,874	21,528
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)	26,077	28,331	2,086	2,266
	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	6,649	6,113	531	489
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	6,649	6,113	531	489
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	74,620	74,620	5,969	5,969
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	2,171	35	173	2
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,881,104	2,845,650	230,488	227,652