

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	3,729,730	3,694,471	298,378	295,557
2	うち、標準的手法適用分	171,526	171,837	13,722	13,746
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,235,887	3,215,205	258,870	257,216
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	248,850	233,809	19,908	18,704
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	1,389	1,362	111	109
	その他	72,076	72,255	5,766	5,780
6	カウンターパーティー信用リスク	38,009	41,484	3,040	3,318
7	うち、SA-CCR適用分	21,487	31,334	1,718	2,506
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	613	461	49	36
9	その他	15,908	9,689	1,272	775
10	CVAリスク	39,049	52,070	3,123	4,165
	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	39,049	52,070	3,123	4,165
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	601,322	592,362	48,105	47,388
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 (リスク・スルー方式)	419,175	397,302	33,534	31,784
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)	32,661	36,757	2,612	2,940
	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	21,511	22,522	1,720	1,801
17	うち、内部格付準拠方式適用分	14,582	15,252	1,166	1,220
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,828	6,929	546	554
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	240	-	19
	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	151,757	12,140	12,140
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	31,397	25,330	2,511	2,026
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,064,615	5,014,058	405,169	401,124