

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	
		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	57,437,218	53,538,029	4,594,977	4,283,042
2	うち、標準的手法適用分				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	43,499,970	40,222,931	3,479,997	3,217,834
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	650,731	625,185	52,058	50,014
5	うち、先進的内部格付手法適用分	11,406,074	10,984,254	912,485	878,740
	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	1,880,442	1,705,657	150,435	136,452
6	カウンターパーティ信用リスク	1,382,178	1,282,000	110,574	102,560
7	うち、SA-CCR適用分	969,432	837,460	77,554	66,996
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	33,834	4,508	2,706	360
9	その他	378,912	440,031	30,312	35,202
10	CVAリスク	1,456,532	1,460,143	116,522	116,811
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,394,352	1,398,509	111,548	111,880
	うち、限定的なBA-CVA適用分	62,179	61,633	4,974	4,930
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	1,258,282	1,696,748	100,662	135,739
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）	4,237,337	4,051,529	338,986	324,122
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）				
	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%）	80,941	62,983	6,475	5,038
	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%）	728,954	534,821	58,316	42,785
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%）	168,742	330,269	13,499	26,421
15	未決済取引	750		60	
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	1,653,385	1,460,150	132,270	116,812
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,407,307	1,234,657	112,584	98,772
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	243,144	223,219	19,451	17,857
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,933	2,273	234	181
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
20	マーケット・リスク	1,571,047	738,704	125,683	59,096
21	うち、標準的方式適用分	1,571,047	738,704	125,683	59,096
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	2,655,087	2,655,087	212,407	212,407
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	1,317,591	1,306,897	105,407	104,551
26	フロア調整				
27	合計	73,948,050	69,117,365	5,915,844	5,529,389