

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	68,046,642	63,756,249	5,443,731	5,100,499
2	うち、標準的手法適用分	5,421,258	4,910,550	433,700	392,844
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	42,711,900	39,776,870	3,416,952	3,182,149
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	724,410	661,841	57,952	52,947
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,993,363	14,273,534	1,199,469	1,141,882
	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	27,014	32,714	2,161	2,617
	その他	4,168,695	4,100,737	333,495	328,059
6	カウンターパーティ信用リスク	2,885,434	2,819,541	230,834	225,563
7	うち、SA-CCR適用分	2,040,969	1,835,552	163,277	146,844
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	88,978	103,369	7,118	8,269
9	その他	755,485	880,620	60,438	70,449
10	CVAリスク	2,780,656	2,798,655	222,452	223,892
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,898,820	2,022,310	151,905	161,784
	うち、限定的なBA-CVA適用分	881,836	776,344	70,546	62,107
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	1,408,549	1,863,940	112,683	149,115
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）	4,274,214	4,086,236	341,937	326,898
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（マंड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%）	243,851	234,994	19,508	18,799
	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%）	834,661	625,253	66,772	50,020
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%）	341,575	515,209	27,326	41,216
15	未決済取引	15	6	1	0
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	1,717,775	1,515,763	137,422	121,261
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,444,783	1,268,095	115,582	101,447
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	253,702	230,517	20,296	18,441
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,235	2,783	338	222
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	15,054	14,366	1,204	1,149
20	マーケット・リスク	4,139,883	3,138,892	331,190	251,111
21	うち、標準的方式適用分	4,014,749	3,023,055	321,179	241,844
22	うち、内部モデル方式適用分				
	うち、簡易的方式適用分	125,134	115,836	10,010	9,266
23	勘定間の振替分				
24	オペレーショナル・リスク	5,976,404	5,976,404	478,112	478,112
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	3,192,232	3,159,747	255,378	252,779
26	フロア調整				
27	合計	95,841,896	90,490,896	7,667,351	7,239,271