

リスク・アセットの概要（2024年12月末）

【連結】

（単位：百万円）

OVI: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	5,261,487	5,167,086	420,919	413,366
2	うち、標準的手法適用分	93,891	74,671	7,511	5,973
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,754,723	4,691,781	380,377	375,342
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	282,816	271,113	22,625	21,689
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	11,008	10,579	880	846
	その他	119,047	118,939	9,523	9,515
6	カウンターパーティ信用リスク	29,072	32,419	2,325	2,593
7	うち、SA-CCR適用分	22,922	24,449	1,833	1,955
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	1,681	1,434	134	114
9	その他	4,468	6,535	357	522
10	CVAリスク	72,989	73,817	5,839	5,905
	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	72,989	73,817	5,839	5,905
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	343,714	343,106	27,497	27,448
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）	962,633	913,970	77,010	73,117
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（マンドレート方式）	123,501	93,446	9,880	7,475
	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%）	1,181	1,353	94	108
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	-	-	-	-
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
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	84,984	79,605	6,798	6,368
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	84,984	79,605	6,798	6,368
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	225,186	225,186	18,014	18,014
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	59,306	59,678	4,744	4,774
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	7,164,059	6,989,669	573,124	559,173

【単体】

(単位:百万円)

OVI: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	5,257,086	5,151,448	420,566	412,115
2	うち、標準的手法適用分	69,910	52,774	5,592	4,221
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,785,872	4,709,173	382,869	376,733
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	282,816	271,113	22,625	21,689
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	118,487	118,386	9,478	9,470
6	カウンターパーティ信用リスク	25,964	28,543	2,077	2,283
7	うち、SA-CCR適用分	22,922	24,449	1,833	1,955
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	1,677	1,430	134	114
9	その他	1,365	2,662	109	212
10	CVAリスク	72,989	73,817	5,839	5,905
	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	72,989	73,817	5,839	5,905
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	263,919	260,415	21,113	20,833
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)	963,671	913,970	77,093	73,117
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)	123,502	93,446	9,880	7,475
	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%)	1,195	1,353	95	108
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	-	-	-	-
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
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	84,967	79,600	6,797	6,368
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	84,967	79,600	6,797	6,368
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	199,997	199,997	15,999	15,999
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	34,392	34,683	2,751	2,774
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	7,027,686	6,837,276	562,214	546,982