

連結リスク・アセットの概要
(2024年12月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2024年12月末)	前四半期末 (2024年9月末)	当四半期末 (2024年12月末)	前四半期末 (2024年9月末)
1	信用リスク	3,498,169	3,464,875	279,853	277,190
2	うち、標準的手法適用分	792,472	818,362	63,397	65,468
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,510,562	2,461,524	200,844	196,921
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	130,248	120,156	10,419	9,612
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	64,886	64,832	5,190	5,186
6	カウンターパーティ信用リスク	21,790	26,056	1,743	2,084
7	うち、SA-CCR適用分	12,090	16,627	967	1,330
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	54	42	4	3
9	その他	9,645	9,386	771	750
10	CVAリスク	24,660	35,601	1,972	2,848
	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	24,660	35,601	1,972	2,848
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	-	-	-	-
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)	77,319	80,155	6,185	6,412
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)	94,146	83,118	7,531	6,649
	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	13,021	13,207	1,041	1,056
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	13,021	13,207	1,041	1,056
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	135,892	135,892	10,871	10,871
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	41,780	36,976	3,342	2,958
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,906,780	3,875,883	312,542	310,070