

単体リスク・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	3,429,012	3,399,658	274,321	271,972
2	うち、標準的手法適用分	717,020	747,661	57,361	59,812
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,520,592	2,470,725	201,647	197,658
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	61,150	61,115	4,892	4,889
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)	77,705	80,542	6,216	6,443
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レート方式)	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25%)	-	-	-	-
	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40%)	-	-	-	-
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125%)	-	-	-	-
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、125%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	96,069	96,069	7,685	7,685
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	33,810	30,745	2,704	2,459
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,790,217	3,764,998	303,217	301,199