

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	
		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	40,722,636	41,103,964	3,446,855	3,479,353
2	うち、標準的手法適用分				
3	うち、内部格付手法適用分	39,384,313	39,799,335	3,339,789	3,374,983
	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	1,338,323	1,304,629	107,065	104,370
4	カウンターパーティ信用リスク	3,262,887	3,465,369	266,457	283,142
5	うち、SA-CCR適用分				
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	845,311	914,452	71,682	77,545
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分				
	うち、CVAリスク	2,024,238	2,101,045	161,939	168,083
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	108,042	132,363	8,643	10,589
	その他	285,295	317,508	24,193	26,924
7	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	774,541	467,266	65,681	39,624
8	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）	2,519,723	2,174,634	201,577	173,970
9	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%）	43,305	11,838	3,672	1,003
	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%）	378,562	525,478	32,102	44,560
10	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%）	98,933	50,749	7,914	4,059
11	未決済取引				
12	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	1,255,452	1,420,149	100,436	113,611
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,038,477	1,167,752	83,078	93,420
14	うち、外部格付準拠方式適用分	212,863	247,686	17,029	19,814
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,111	4,710	328	376
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
16	マーケット・リスク	2,229,655	2,403,111	178,372	192,248
17	うち、標準的方式適用分	4,239	5,108	339	408
18	うち、内部モデル方式適用分	2,225,415	2,398,002	178,033	191,840
19	オペレーショナル・リスク	2,529,600	2,481,876	202,368	198,550
20	うち、基礎的手法適用分				
21	うち、粗利益配分手法適用分				
22	うち、先進的計測手法適用分	2,529,600	2,481,876	202,368	198,550
23	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	833,081	1,225,589	70,645	103,929
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額				
24	フロア調整	7,901,999	7,449,466	632,159	595,957
25	合計（スケーリングファクター適用後）	65,103,047	65,375,184	5,208,243	5,230,014