

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3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	57,214,178		4,577,134	
2	うち、標準的手法適用分				
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	43,146,471		3,451,717	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	614,990		49,199	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	11,689,737		935,178	
	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	1,762,979		141,038	
6	カウンターパーティ信用リスク	1,164,443		93,155	
7	うち、SA-CCR適用分	911,520		72,921	
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	4,959		396	
9	その他	247,963		19,837	
10	CVAリスク	1,411,023		112,881	
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,299,166		103,933	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	111,856		8,948	
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	2,129,103		170,328	
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）	4,666,887		373,351	
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）				
	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%）	91,281		7,302	
	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%）	466,237		37,299	
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%）	381,992		30,559	
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	1,444,717		115,577	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,279,266		102,341	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	163,191		13,055	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,260		180	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
20	マーケット・リスク	693,565		55,485	
21	うち、標準的方式適用分	693,565		55,485	
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	2,487,212		198,976	
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	2,347,977		187,838	
26	フロア調整				
27	合計	74,498,621		5,959,889	

国際様式の 該当番号		OV1：リスク・アセットの概要			
		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク		41,880,637		3,544,460
2	うち、標準的手法適用分				
3	うち、内部格付手法適用分		40,418,657		3,427,502
	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		1,461,979		116,958
4	カウンターパーティ信用リスク		3,085,771		252,708
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		857,896		72,749
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分				
	うち、CVAリスク		1,760,551		140,844
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		107,175		8,574
	その他		360,147		30,540
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		1,583,421		134,274
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）		3,448,840		275,907
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%）		43,517		3,690
	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%）		723,468		61,350
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%）		104,481		8,358
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		1,243,466		99,477
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		1,059,277		84,742
14	うち、外部格付準拠方式適用分		181,480		14,518
15	うち、標準的手法準拠方式適用分		2,708		216
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
16	マーケット・リスク		1,486,589		118,927
17	うち、標準的方式適用分		14,952		1,196
18	うち、内部モデル方式適用分		1,471,636		117,730
19	オペレーショナル・リスク		2,715,316		217,225
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		2,715,316		217,225
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		1,408,672		119,455
	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		8,845,979		707,678
25	合計（スケーリングファクター適用後）		69,293,909		5,543,512