

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9月末	2023年6月末	2023年9月末	2023年6月末
1	信用リスク	42,632,458	42,275,408	3,607,909	3,578,261
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	41,106,853	40,881,007	3,485,861	3,466,709
	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	1,525,604	1,394,400	122,048	111,552
4	カウンターパーティ信用リスク	3,564,944	3,558,789	291,561	291,043
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	965,379	966,455	81,864	81,955
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,129,088	2,138,888	170,327	171,111
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	109,684	98,981	8,774	7,918
	その他	360,792	354,464	30,595	30,058
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	1,455,602	869,491	123,435	73,732
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）	3,393,368	3,072,838	271,469	245,827
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％）	57,294	43,558	4,858	3,693
	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％）	687,518	449,993	58,301	38,159
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％）	101,734	100,336	8,138	8,026
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	1,269,041	1,259,911	101,523	100,792
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,048,748	1,029,792	83,899	82,383
14	うち、外部格付準拠方式適用分	217,218	222,261	17,377	17,780
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	3,074	7,857	245	628
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	1,396,547	1,821,527	111,723	145,722
17	うち、標準的方式適用分	12,516	12,770	1,001	1,021
18	うち、内部モデル方式適用分	1,384,031	1,808,756	110,722	144,700
19	オペレーショナル・リスク	2,633,511	2,536,301	210,680	202,904
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	2,633,511	2,536,301	210,680	202,904
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	979,896	666,568	83,095	56,525
	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	9,218,480	9,068,022	737,478	725,441
25	合計（スケーリングファクター適用後）	70,127,199	68,376,639	5,610,175	5,470,131