

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	66,152,556		5,292,204	
2	うち、標準的手法適用分	4,534,078		362,726	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	42,010,716		3,360,857	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	644,912		51,593	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,658,740		1,172,699	
	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	32,604		2,608	
	その他	4,271,504		341,720	
6	カウンターパーティ信用リスク	2,767,485		221,398	
7	うち、SA-CCR適用分	1,828,241		146,259	
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	59,849		4,787	
9	その他	879,393		70,351	
10	CVAリスク	2,412,722		193,017	
	うち、SA-CVA適用分	—		—	
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,808,479		144,678	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	604,242		48,339	
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	2,329,143		186,331	
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）	4,691,335		375,306	
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％）	252,616		20,209	
	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％）	540,466		43,237	
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％）	570,086		45,606	
15	未決済取引	0		0	
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	1,488,838		119,107	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,317,929		105,434	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	168,648		13,491	
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	2,926,210		234,096	
21	うち、標準的方式適用分	2,812,666		225,013	
22	うち、内部モデル方式適用分	—		—	
	うち、簡易的方式適用分	113,543		9,083	
23	勘定間の振替分	—		—	
24	オペレーショナル・リスク	5,545,060		443,604	
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	3,172,056		253,764	
26	フロア調整	—		—	
27	合計	92,848,578		7,427,886	

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		51,660,375		4,338,292
2	うち、標準的手法適用分		4,255,538		340,443
3	うち、内部格付手法適用分		42,804,763		3,629,843
	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		34,779		2,782
	その他		4,565,293		365,223
4	カウンターパーティ信用リスク		5,266,833		429,643
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		1,596,891		134,365
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		—		—
	うち、CVAリスク		2,539,372		203,149
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		338,403		27,072
	その他		792,166		65,056
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		1,758,270		149,101
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）		3,481,884		278,550
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％）		118,360		9,681
	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％）		905,808		76,012
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％）		280,177		22,414
11	未決済取引		8		0
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		1,304,026		104,322
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		1,099,385		87,950
14	うち、外部格付準拠方式適用分		187,741		15,019
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		14,191		1,135
16	マーケット・リスク		3,691,711		295,336
17	うち、標準的方式適用分		1,484,171		118,733
18	うち、内部モデル方式適用分		2,207,539		176,603
19	オペレーショナル・リスク		5,167,475		413,398
20	うち、基礎的手法適用分		1,158,203		92,656
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		4,009,271		320,741
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		3,042,373		257,792
	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		1,931,206		154,496
25	合計（スケーリングファクター適用後）		81,613,040		6,529,043