

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2023年6月末	2023年3月末	2023年6月末	2023年3月末
1	信用リスク	50,194,223	48,133,282	4,217,762	4,043,801
2	うち、標準的手法適用分	3,795,546	3,650,094	303,643	292,007
3	うち、内部格付手法適用分	42,130,096	40,237,209	3,572,632	3,412,115
	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	34,109	36,042	2,728	2,883
	その他	4,234,471	4,209,936	338,757	336,794
4	カウンターパーティ信用リスク	5,740,742	5,247,547	468,233	427,703
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	1,698,872	1,503,981	142,964	126,501
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分				
	うち、CVAリスク	2,833,568	2,594,370	226,685	207,549
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	329,972	284,745	26,397	22,779
	その他	878,328	864,450	72,185	70,872
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	1,045,098	847,614	88,624	71,877
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）	3,106,297	2,550,305	248,503	204,024
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%）	84,246	85,894	6,953	7,083
	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%）	643,592	550,764	53,725	45,946
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%）	284,769	271,158	22,781	21,692
11	未決済取引	73	255	6	21
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	1,319,572	1,311,406	105,565	104,912
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,066,657	1,074,905	85,332	85,992
14	うち、外部格付準拠方式適用分	230,859	218,204	18,468	17,456
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	7,857	4,111	628	328
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,197	14,184	1,135	1,134
16	マーケット・リスク	3,765,126	4,474,842	301,210	357,987
17	うち、標準的方式適用分	1,350,619	1,607,836	108,049	128,626
18	うち、内部モデル方式適用分	2,414,507	2,867,006	193,160	229,360
19	オペレーショナル・リスク	4,803,489	4,870,622	384,279	389,649
20	うち、基礎的手法適用分	1,112,261	1,112,261	88,980	88,980
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	3,691,227	3,758,360	295,298	300,668
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	3,093,899	3,239,127	262,064	273,891
	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	3,387,069	2,927,635	270,965	234,210
25	合計（スケールリングファクター適用後）	80,383,446	77,285,048	6,430,675	6,182,803