

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	51,181,869	50,194,223	4,299,171	4,217,762
2	うち、標準的手法適用分	4,128,952	3,795,546	330,316	303,643
3	うち、内部格付手法適用分	42,629,651	42,130,096	3,614,994	3,572,632
	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	35,251	34,109	2,820	2,728
	その他	4,388,014	4,234,471	351,041	338,757
4	カウンターパーティ信用リスク	5,748,057	5,740,742	468,745	468,233
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	1,736,111	1,698,872	146,083	142,964
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,716,425	2,833,568	217,314	226,685
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	391,476	329,972	31,318	26,397
	その他	904,043	878,328	74,030	72,185
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	1,614,272	1,045,098	136,890	88,624
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）	3,426,634	3,106,297	274,130	248,503
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（マંデット方式）	—	—	—	—
	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%）	130,115	84,246	10,688	6,953
	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%）	878,138	643,592	73,630	53,725
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%）	247,586	284,769	19,806	22,781
11	未決済取引	32	73	2	6
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	1,327,517	1,319,572	106,201	105,565
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,086,171	1,066,657	86,893	85,332
14	うち、外部格付準拠方式適用分	224,076	230,859	17,926	18,468
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	14,195	14,197	1,135	1,135
16	マーケット・リスク	3,613,364	3,765,126	289,069	301,210
17	うち、標準的方式適用分	1,548,018	1,350,619	123,841	108,049
18	うち、内部モデル方式適用分	2,065,345	2,414,507	165,227	193,160
19	オペレーショナル・リスク	5,059,369	4,803,489	404,749	384,279
20	うち、基礎的手法適用分	1,158,203	1,112,261	92,656	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	3,901,165	3,691,227	312,093	295,298
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	3,259,610	3,093,899	275,912	262,064
	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	2,553,512	3,387,069	204,281	270,965
25	合計（スケーリングファクター適用後）	82,040,996	80,383,446	6,563,279	6,430,675