

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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	60,844,560	59,323,638	4,867,564	4,745,891
2	うち、標準的手法適用分	1,440,546	1,398,503	115,243	111,880
3	うち、基礎的的内部格付手法適用分	43,375,137	42,209,315	3,470,011	3,376,745
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	664,182	644,912	53,134	51,593
5	うち、先進的的内部格付手法適用分	12,803,609	12,559,150	1,024,288	1,004,732
	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	23,615	23,100	1,889	1,848
	その他	2,537,468	2,488,655	202,997	199,092
6	カウンターパーティ信用リスク	2,170,116	1,922,129	173,609	153,770
7	うち、SA-CCR適用分	1,748,072	1,590,346	139,845	127,227
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	74,193	28,940	5,935	2,315
9	その他	347,851	302,842	27,828	24,227
10	CVAリスク	2,379,368	2,045,772	190,349	163,661
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	2,041,178	1,815,956	163,294	145,276
	うち、限定的なBA-CVA適用分	338,189	229,815	27,055	18,385
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	2,194,678	2,155,720	175,574	172,457
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）	4,791,839	4,680,461	383,347	374,436
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%）	72,157	93,981	5,772	7,518
	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%）	497,979	472,002	39,838	37,760
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%）	458,025	515,484	36,642	41,238
15	未決済取引	87	19	6	1
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	1,547,278	1,488,838	123,782	119,107
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,337,659	1,317,929	107,012	105,434
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	206,780	168,648	16,542	13,491
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,838	2,260	227	180
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
20	マーケット・リスク	2,614,714	1,792,417	209,177	143,393
21	うち、標準的方式適用分	2,561,512	1,738,948	204,920	139,115
22	うち、内部モデル方式適用分				
	うち、簡易的方式適用分	53,202	53,469	4,256	4,277
23	勘定間の振替分				
24	オペレーショナル・リスク	3,966,778	3,966,778	317,342	317,342
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	2,355,227	2,184,006	188,418	174,720
26	フロア調整				
27	合計	83,892,810	80,641,252	6,711,424	6,451,300