

## OV1：リスク・アセットの概要

| 国際様式の<br>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                                            | 57,621,146 | 57,214,178 | 4,609,691 | 4,577,134 |
| 2             | うち、標準的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 3             | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 43,402,880 | 43,146,471 | 3,472,230 | 3,451,717 |
| 4             | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 625,417    | 614,990    | 50,033    | 49,199    |
| 5             | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | 11,801,511 | 11,689,737 | 944,120   | 935,178   |
|               | 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                                              | 1,791,336  | 1,762,979  | 143,306   | 141,038   |
| 6             | カウンターパーティ信用リスク                                   | 1,360,877  | 1,164,443  | 108,870   | 93,155    |
| 7             | うち、SA-CCR適用分                                     | 881,942    | 911,520    | 70,555    | 72,921    |
| 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                              | 29,817     | 4,959      | 2,385     | 396       |
| 9             | その他                                              | 449,116    | 247,963    | 35,929    | 19,837    |
| 10            | CVAリスク                                           | 1,482,193  | 1,411,023  | 118,575   | 112,881   |
|               | うち、SA-CVA適用分                                     | —          | —          | —         | —         |
|               | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | 1,412,331  | 1,299,166  | 112,986   | 103,933   |
|               | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | 69,861     | 111,856    | 5,588     | 8,948     |
| 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           | 2,151,120  | 2,129,103  | 172,089   | 170,328   |
| 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）      | 4,768,724  | 4,666,887  | 381,497   | 373,351   |
| 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％）      | 69,327     | 91,281     | 5,546     | 7,302     |
|               | 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％）      | 486,558    | 466,237    | 38,924    | 37,299    |
| 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％） | 350,806    | 381,992    | 28,064    | 30,559    |
| 15            | 未決済取引                                            | 1,128      | —          | 90        | —         |
| 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               | 1,504,652  | 1,444,717  | 120,372   | 115,577   |
| 17            | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | 1,300,168  | 1,279,266  | 104,013   | 102,341   |
| 18            | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                           | 201,645    | 163,191    | 16,131    | 13,055    |
| 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                                        | 923,143    | 693,565    | 73,851    | 55,485    |
| 21            | うち、標準的方式適用分                                      | 923,143    | 693,565    | 73,851    | 55,485    |
| 22            | うち、内部モデル方式適用分                                    | —          | —          | —         | —         |
|               | うち、簡易的方式適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 23            | 勘定間の振替分                                          | —          | —          | —         | —         |
| 24            | オペレーショナル・リスク                                     | 2,487,212  | 2,487,212  | 198,976   | 198,976   |
| 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                 | 2,516,986  | 2,347,977  | 201,358   | 187,838   |
| 26            | フロア調整                                            | —          | —          | —         | —         |
| 27            | 合計                                               | 75,723,878 | 74,498,621 | 6,057,910 | 5,959,889 |