

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9月末	2024年6月末	2024年9月末	2024年6月末
1	信用リスク	56,733,946	60,844,560	4,538,715	4,867,564
2	うち、標準的手法適用分	1,626,649	1,440,546	130,131	115,243
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	39,975,570	43,375,137	3,198,045	3,470,011
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	661,841	664,182	52,947	53,134
5	うち、先進的内部格付手法適用分	12,043,048	12,803,609	963,443	1,024,288
	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	24,891	23,615	1,991	1,889
	その他	2,401,944	2,537,468	192,155	202,997
6	カウンターパーティ信用リスク	2,036,197	2,170,116	162,895	173,609
7	うち、SA-CCR適用分	1,595,691	1,748,072	127,655	139,845
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	74,052	74,193	5,924	5,935
9	その他	366,454	347,851	29,316	27,828
10	CVAリスク	2,344,949	2,379,368	187,595	190,349
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,991,900	2,041,178	159,352	163,294
	うち、限定的なBA-CVA適用分	353,049	338,189	28,243	27,055
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	1,734,441	2,194,678	138,755	175,574
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）	4,074,168	4,791,839	325,933	383,347
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%）	67,212	72,157	5,376	5,772
	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%）	541,288	497,979	43,303	39,838
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%）	449,453	458,025	35,956	36,642
15	未決済取引	6	87	0	6
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	1,500,887	1,547,278	120,070	123,782
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,268,095	1,337,659	101,447	107,012
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	230,517	206,780	18,441	16,542
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	2,273	2,838	181	227
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分				
20	マーケット・リスク	1,974,114	2,614,714	157,929	209,177
21	うち、標準的方式適用分	1,910,257	2,561,512	152,820	204,920
22	うち、内部モデル方式適用分				
	うち、簡易的方式適用分	63,857	53,202	5,108	4,256
23	勘定間の振替分				
24	オペレーショナル・リスク	4,351,963	3,966,778	348,157	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	2,432,713	2,355,227	194,617	188,418
26	フロア調整				
27	合計	78,241,344	83,892,810	6,259,307	6,711,424