

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	53,538,029	57,621,146	4,283,042	4,609,691
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	40,222,931	43,402,880	3,217,834	3,472,230
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	625,185	625,417	50,014	50,033
5	うち、先進的内部格付手法適用分	10,984,254	11,801,511	878,740	944,120
	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	1,705,657	1,791,336	136,452	143,306
6	カウンターパーティ信用リスク	1,282,000	1,360,877	102,560	108,870
7	うち、SA-CCR適用分	837,460	881,942	66,996	70,555
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	4,508	29,817	360	2,385
9	その他	440,031	449,116	35,202	35,929
10	CVAリスク	1,460,143	1,482,193	116,811	118,575
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	1,398,509	1,412,331	111,880	112,986
	うち、限定的なBA-CVA適用分	61,633	69,861	4,930	5,588
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	1,696,748	2,151,120	135,739	172,089
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）	4,051,529	4,768,724	324,122	381,497
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%）	62,983	69,327	5,038	5,546
	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%）	534,821	486,558	42,785	38,924
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%）	330,269	350,806	26,421	28,064
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	1,460,150	1,504,652	116,812	120,372
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	1,234,657	1,300,168	98,772	104,013
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	223,219	201,645	17,857	16,131
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	738,704	923,143	59,096	73,851
21	うち、標準的方式適用分	738,704	923,143	59,096	73,851
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	2,655,087	2,487,212	212,407	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	1,306,897	2,516,986	104,551	201,358
26	フロア調整				
27	合計	69,117,365	75,723,878	5,529,389	6,057,910