

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	68,009,795	66,152,556	5,440,783	5,292,204
2	うち、標準的手法適用分	4,771,327	4,534,078	381,706	362,726
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	43,239,426	42,010,716	3,459,154	3,360,857
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	664,182	644,912	53,134	51,593
5	うち、先進的内部格付手法適用分	14,967,501	14,658,740	1,197,400	1,172,699
	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	32,144	32,604	2,571	2,608
	その他	4,335,213	4,271,504	346,817	341,720
6	カウンターパーティ信用リスク	2,960,059	2,767,485	236,804	221,398
7	うち、SA-CCR適用分	2,033,512	1,828,241	162,681	146,259
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	110,521	59,849	8,841	4,787
9	その他	816,025	879,393	65,282	70,351
10	CVAリスク	2,846,990	2,412,722	227,759	193,017
	うち、SA-CVA適用分				
	うち、完全なBA-CVA適用分	2,059,778	1,808,479	164,782	144,678
	うち、限定的なBA-CVA適用分	787,212	604,242	62,977	48,339
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	2,333,115	2,329,143	186,649	186,331
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）	4,804,880	4,691,335	384,390	375,306
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%）	247,895	252,616	19,831	20,209
	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%）	580,282	540,466	46,422	43,237
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%）	510,587	570,086	40,846	45,606
15	未決済取引	87	0	6	0
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	1,567,334	1,488,838	125,386	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	3,533	2,260	282	180
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	19,360		1,548	
20	マーケット・リスク	4,019,958	2,926,210	321,596	234,096
21	うち、標準的方式適用分	3,677,807	2,812,666	294,224	225,013
22	うち、内部モデル方式適用分				
	うち、簡易的方式適用分	342,150	113,543	27,372	9,083
23	勘定間の振替分				
24	オペレーショナル・リスク	5,545,060	5,545,060	443,604	443,604
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	3,286,266	3,172,056	262,901	253,764
26	フロア調整				
27	合計	96,712,314	92,848,578	7,736,985	7,427,886