

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	63,756,249	68,009,795	5,100,499	5,440,783
2	うち、標準的手法適用分	4,910,550	4,771,327	392,844	381,706
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	39,776,870	43,239,426	3,182,149	3,459,154
4	うち、スロットティング・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	14,273,534	14,967,501	1,141,882	1,197,400
	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	32,714	32,144	2,617	2,571
	その他	4,100,737	4,335,213	328,059	346,817
6	カウンターパーティ信用リスク	2,819,541	2,960,059	225,563	236,804
7	うち、SA-CCR適用分	1,835,552	2,033,512	146,844	162,681
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	103,369	110,521	8,269	8,841
9	その他	880,620	816,025	70,449	65,282
10	C V A リスク	2,798,655	2,846,990	223,892	227,759
	うち、SA-CVA適用分	—	—	—	—
	うち、完全なBA-CVA適用分	2,022,310	2,059,778	161,784	164,782
	うち、限定的なBA-CVA適用分	776,344	787,212	62,107	62,977
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	1,863,940	2,333,115	149,115	186,649
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）	4,086,236	4,804,880	326,898	384,390
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％）	234,994	247,895	18,799	19,831
	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％）	625,253	580,282	50,020	46,422
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％）	515,209	510,587	41,216	40,846
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	1,515,763	1,567,334	121,261	125,386
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	2,783	3,533	222	282
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	14,366	19,360	1,149	1,548
20	マーケット・リスク	3,138,892	4,019,958	251,111	321,596
21	うち、標準的方式適用分	3,023,055	3,677,807	241,844	294,224
22	うち、内部モデル方式適用分	—	—	—	—
	うち、簡易的方式適用分	115,836	342,150	9,266	27,372
23	勘定間の振替分	—	—	—	—
24	オペレーショナル・リスク	5,976,404	5,545,060	478,112	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	3,159,747	3,286,266	252,779	262,901
26	フロア調整	—	—	—	—
27	合計	90,490,896	96,712,314	7,239,271	7,736,985