

リスク・アセットの概要

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
		1	信用リスク	2,206,154	2,113,535
2	うち、標準的手法適用分	89,211	16,325	7,136	1,306
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,867,136	1,873,344	149,370	149,867
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	213,374	186,396	17,069	14,911
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	36,431	37,469	2,914	2,997
6	カウンターパーティー信用リスク	27,521	26,859	2,201	2,148
7	うち、SA-CCR適用分	17,692	20,187	1,415	1,615
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	470	485	37	38
9	その他	9,358	6,185	748	494
10	CVAリスク	35,418	39,203	2,833	3,136
	うち、SA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	35,418	39,203	2,833	3,136
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	293,268	237,481	23,461	18,998
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)	244,767	231,895	19,581	18,551
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(マニフェスト方式)	26,920	31,482	2,153	2,518
	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%)	-	-	-	-
	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%)	-	-	-	-
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%)	-	-	-	-
15	未決済取引	-	-	-	-
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	6,217	6,450	497	516
17	うち、内部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	5,267	5,427	421	434
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	949	1,023	75	81
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
20	マーケット・リスク	-	-	-	-
21	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
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	67,453	69,124	5,396	5,529
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	22	1,878	1	150
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,907,744	2,757,910	232,619	220,632