

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		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	3,912,560	3,790,772	313,004	303,261
2	うち、標準的手法適用分	184,098	58,102	14,727	4,648
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,406,127	3,438,595	272,490	275,087
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	247,366	220,512	19,789	17,641
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値のエクスポージャー	1,300	1,218	104	97
	その他	73,667	72,343	5,893	5,787
6	カウンターパーティー信用リスク	36,514	36,808	2,921	2,944
7	うち、SA-CCR適用分	22,943	26,426	1,835	2,114
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	545	502	43	40
9	その他	13,026	9,879	1,042	790
10	CVAリスク	44,957	48,696	3,596	3,895
	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	44,957	48,696	3,596	3,895
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	499,131	426,976	39,930	34,158
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)	363,695	341,084	29,095	27,286
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)	36,110	42,702	2,888	3,416
	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	23,542	24,159	1,883	1,932
17	うち、内部格付準拠方式適用分	15,788	16,162	1,263	1,293
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,460	6,629	516	530
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,191	1,265	95	101
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	101	101	8	8
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	140,473	143,381	11,237	11,470
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	6,710	25,595	536	2,047
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,063,696	4,880,176	405,095	390,414