

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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	2,198,100	2,206,154	175,848	176,492
2	うち、標準的手法適用分	90,929	89,211	7,274	7,136
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,860,723	1,867,136	148,857	149,370
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	210,379	213,374	16,830	17,069
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	36,068	36,431	2,885	2,914
6	カウンターパーティー信用リスク	30,991	27,521	2,479	2,201
7	うち、SA-CCR適用分	17,023	17,692	1,361	1,415
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	317	470	25	37
9	その他	13,651	9,358	1,092	748
10	CVAリスク	32,702	35,418	2,616	2,833
	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	32,702	35,418	2,616	2,833
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	348,351	293,268	27,868	23,461
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)	260,104	244,767	20,808	19,581
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)	26,274	26,920	2,101	2,153
	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	6,212	6,217	496	497
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	5,268	5,267	421	421
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	943	949	75	75
	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	67,453	5,396	5,396
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	38	22	3	1
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,970,230	2,907,744	237,618	232,619