

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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	3,909,084	3,912,560	312,726	313,004
2	うち、標準的手法適用分	191,048	184,098	15,283	14,727
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,399,501	3,406,127	271,960	272,490
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	243,921	247,366	19,513	19,789
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	1,308	1,300	104	104
	その他	73,304	73,667	5,864	5,893
6	カウンターパーティー信用リスク	39,947	36,514	3,195	2,921
7	うち、SA-CCR適用分	22,955	22,943	1,836	1,835
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	430	545	34	43
	その他	16,561	13,026	1,324	1,042
10	CVAリスク	45,884	44,957	3,670	3,596
	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	45,884	44,957	3,670	3,596
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	565,181	499,131	45,214	39,930
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)	379,309	363,695	30,344	29,095
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)	35,360	36,110	2,828	2,888
	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	23,403	23,542	1,872	1,883
17	うち、内部格付準拠方式適用分	15,466	15,788	1,237	1,263
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,652	6,460	532	516
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,184	1,191	94	95
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	100	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	140,473	11,237	11,237
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	21,680	6,710	1,734	536
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,160,325	5,063,696	412,826	405,095