

■OV1:リスク・アセットの概要（2024年3月末）
連結

(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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2024/3)	前四半期末 (2023/12)	当四半期末 (2024/3)	前四半期末 (2023/12)
1	信用リスク	2,297,911		183,832	
2	うち、標準的手法適用分	2,238,578		179,086	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	-		-	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	-		-	
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	59,332		4,746	
6	カウンターパーティ信用リスク	4,205		336	
7	うち、SA-CCR適用分	4,048		323	
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	-		-	
9	その他	157		12	
10	CVAリスク	20,422		1,633	
	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	20,422		1,633	
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	-		-	
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)	64,424		5,153	
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%)	-		-	
	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	18,752		1,500	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	18,752		1,500	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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	97,273		7,781	
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	-		-	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	2,502,989		200,239	

■OV1:リスク・アセットの概要（2024年3月末）
単体

（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		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2024/3)	前四半期末 (2023/12)	当四半期末 (2024/3)	前四半期末 (2023/12)
1	信用リスク	2,262,374		180,989	
2	うち、標準的手法適用分	2,218,995		177,519	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	-		-	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	-		-	
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	43,379		3,470	
6	カウンターパーティ信用リスク	4,205		336	
7	うち、SA-CCR適用分	4,048		323	
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	-		-	
9	その他	157		12	
10	CVAリスク	20,422		1,633	
	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	20,422		1,633	
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	-		-	
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)	64,394		5,151	
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%)	-		-	
	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	18,752		1,500	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	18,752		1,500	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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	80,174		6,413	
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	-		-	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	2,450,324		196,025	