

リスク・アセットの概要 (2024年3月末)

【連結】

(単位:百万円)

OVI:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
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	5,189,044		415,123	
2	うち、標準的手法適用分	76,124		6,089	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,743,776		379,502	
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	241,509		19,320	
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	10,101		808	
	その他	117,531		9,402	
6	カウンターパーティ信用リスク	32,163		2,573	
7	うち、SA-CCR適用分	24,514		1,961	
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	1,364		109	
9	その他	6,284		502	
10	CVAリスク	73,152		5,852	
	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	73,152		5,852	
11	終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	318,725		25,498	
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)	895,315		71,625	
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)	55,195		4,415	
	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%)	1,385		110	
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	-		-	
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	-		-	
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	84,968		6,797	
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	84,968		6,797	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	222,319		17,785	
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	40,714		3,257	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	6,912,985		553,038	

(単位:百万円)

OVI:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
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		5,454,793		461,550
2	うち、標準的手法適用分		84,615		6,769
3	うち、内部格付手法適用分		5,243,137		444,618
	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		9,918		793
	その他		117,122		9,369
4	カウンターパーティ信用リスク		122,991		10,000
5	うち、SA-CCR適用分		29,196		2,475
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		88,029		7,042
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		1,385		110
	その他		4,379		371
7	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		290,162		24,605
8	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)		997,477		84,499
9	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 (マドレー方式)		102,723		8,217
	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%)		-		-
10	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%)		1,722		137
11	未決済取引		0		0
12	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		-		-
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		-		-
14	うち、外部格付準拠方式適用分		-		-
15	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		-		-
16	マーケット・リスク		160,388		12,831
17	うち、標準的方式適用分		160,388		12,831
18	うち、内部モデル方式適用分		-		-
19	オペレーショナル・リスク		329,318		26,345
20	うち、基礎的手法適用分		-		-
21	うち、粗利益配分手法適用分		329,318		26,345
22	うち、先進的計測手法適用分		-		-
23	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		40,528		3,436
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額		-		-
24	フロア調整		1,342,815		107,425
25	合計		8,842,921		739,050

【単体】

(単位:百万円)

OVI: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	
		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	5,174,417		413,953	
2	うち、標準的手法適用分	51,714		4,137	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,764,201		381,136	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	241,509		19,320	
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	116,991		9,359	
6	カウンターパーティ信用リスク	28,393		2,271	
7	うち、SA-CCR適用分	24,514		1,961	
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	1,358		108	
9	その他	2,519		201	
10	CVAリスク	73,152		5,852	
	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	73,152		5,852	
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	228,777		18,302	
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)	895,315		71,625	
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 (マナドート方式)	55,195		4,415	
	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%)	1,385		110	
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	-		-	
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	-		-	
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	84,963		6,797	
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	84,963		6,797	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	198,302		15,864	
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	16,533		1,322	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	6,756,437		540,514	

(単位:百万円)

OVI: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	
		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		5,434,915		460,042
2	うち、標準的手法適用分		58,107		4,648
3	うち、内部格付手法適用分		5,260,189		446,064
	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		116,617		9,329
4	カウンターパーティ信用リスク		122,991		10,000
5	うち、SA-CCR適用分		29,196		2,475
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分		-		-
	うち、CVAリスク		88,029		7,042
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー		1,385		110
	その他		4,379		371
7	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		209,845		17,794
8	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)		997,477		84,499
9	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)		102,723		8,217
	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%)		-		-
10	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%)		1,722		137
11	未決済取引		0		0
12	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		-		-
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分		-		-
14	うち、外部格付準拠方式適用分		-		-
15	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		-		-
16	マーケット・リスク		158,849		12,707
17	うち、標準的方式適用分		158,849		12,707
18	うち、内部モデル方式適用分		-		-
19	オペレーショナル・リスク		314,634		25,170
20	うち、基礎的手法適用分		-		-
21	うち、粗利益配分手法適用分		314,634		25,170
22	うち、先進的計測手法適用分		-		-
23	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		17,061		1,446
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額		-		-
24	フロア調整		1,167,402		93,392
25	合計		8,527,623		713,410