

リスク・アセットの概要 (2024年6月末)

【連結】

(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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	5,207,048	5,189,044	416,563	415,123
2	うち、標準的手法適用分	74,883	76,124	5,990	6,089
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,756,746	4,743,776	380,539	379,502
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	247,141	241,509	19,771	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	10,227	10,101	818	808
	その他	118,048	117,531	9,443	9,402
6	カウンターパーティ信用リスク	30,609	32,163	2,448	2,573
7	うち、SA-CCR適用分	23,865	24,514	1,909	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	1,563	1,364	125	109
9	その他	5,180	6,284	414	502
10	CVAリスク	84,394	73,152	6,751	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	84,394	73,152	6,751	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	318,955	318,725	25,516	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)	932,930	895,315	74,634	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)	85,890	55,195	6,871	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%)	1,279	1,385	102	110
15	未決済取引	1	-	0	-
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	93,220	84,968	7,457	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	93,220	84,968	7,457	6,797
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	222,319	222,319	17,785	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	41,759	40,714	3,340	3,257
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	7,018,407	6,912,985	561,472	553,038

【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6月末	2024年3月末	2024年6月末	2024年3月末
1	信用リスク	5,193,528	5,174,417	415,482	413,953
2	うち、標準的手法適用分	52,194	51,714	4,175	4,137
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,776,685	4,764,201	382,134	381,136
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	247,141	241,509	19,771	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	117,506	116,991	9,400	9,359
6	カウンターパーティ信用リスク	26,876	28,393	2,150	2,271
7	うち、SA-CCR適用分	23,865	24,514	1,909	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	1,557	1,358	124	108
9	その他	1,453	2,519	116	201
10	CVAリスク	84,394	73,152	6,751	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	84,394	73,152	6,751	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	234,650	228,777	18,772	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)	932,930	895,315	74,634	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 (マデート方式)	85,890	55,195	6,871	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%)	1,279	1,385	102	110
15	未決済取引	1	-	0	-
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	93,192	84,963	7,455	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	93,192	84,963	7,455	6,797
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	198,302	198,302	15,864	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	16,831	16,533	1,346	1,322
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	6,867,877	6,756,437	549,430	540,514