

リスク・アセットの概要（2024年3月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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	4,466,259	4,227,120	357,300	338,169
2	うち、標準的手法適用分	618,249	131,561	49,459	10,524
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,460,183	3,730,010	276,814	298,400
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	272,283	261,398	21,782	20,911
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	12,078	-	966	-
	その他	103,465	104,148	8,277	8,331
6	カウンターパーティ信用リスク	41,724	43,086	3,337	3,446
7	うち、SA-CCR適用分	38,660	39,250	3,092	3,140
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	678	358	54	28
9	その他	2,384	3,477	190	278
10	CVAリスク	155,079	160,707	12,406	12,856
	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	155,079	160,707	12,406	12,856
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	118,542	112,765	9,483	9,021
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）	577,819	525,409	46,225	42,032
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）	43,604	42,877	3,488	3,430
	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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	132	458	10	36
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	132	458	10	36
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	190,342	181,855	15,227	14,548
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	81,968	64,898	6,557	5,191
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,752,042	5,436,574	460,163	434,925

リスク・アセットの概要（2024年3月末）

【連結】 (単位：百万円)

0V1：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	4,375,520	4,107,028	350,041	328,562
2	うち、標準的手法適用分	607,578	8,561	48,606	684
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,402,296	3,741,026	272,183	299,282
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	272,283	261,398	21,782	20,911
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	93,362	96,041	7,469	7,683
6	カウンターパーティ信用リスク	41,724	43,088	3,337	3,447
7	うち、SA-CCR適用分	38,660	39,252	3,092	3,140
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	678	358	54	28
9	その他	2,384	3,477	190	278
10	CVAリスク	155,079	160,707	12,406	12,856
	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	155,079	160,707	12,406	12,856
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	117,074	110,944	9,365	8,875
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）	590,230	537,225	47,218	42,978
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）	43,601	42,873	3,488	3,429
	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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	122	332	9	26
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	122	332	9	26
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	177,628	177,783	14,210	14,222
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	3,305	3,294	264	263
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,580,856	5,260,676	446,468	420,854

リスク・アセットの概要（2024年3月末）

【単体】

（単位：百万円）

0V1：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	4,361,835	4,095,989	348,946	327,679
2	うち、標準的手法適用分	599,634	180	47,970	14
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,396,975	3,739,093	271,758	299,127
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	272,283	261,398	21,782	20,911
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	92,942	95,316	7,435	7,625
6	カウンターパーティ信用リスク	41,724	43,088	3,337	3,447
7	うち、SA-CCR適用分	38,660	39,252	3,092	3,140
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	678	358	54	28
9	その他	2,384	3,477	190	278
10	CVAリスク	155,079	160,707	12,406	12,856
	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	155,079	160,707	12,406	12,856
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	295,487	263,448	23,638	21,075
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）	589,722	536,749	47,177	42,939
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）	43,600	42,872	3,488	3,429
	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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	76,568	77,395	6,125	6,191
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	122	887	9	70
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	122	887	9	70
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	165,088	163,066	13,207	13,045
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	927	940	74	75
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,730,157	5,385,147	458,412	430,811