

| OV1：リスク・アセットの概要 | | イ | ロ | ハ | ニ |
|-----------------|--|------------|------------|-----------|-----------|
| 国際株式の 該当番号 | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 2021年3月末 | 2020年12月末 | 2021年3月末 | 2020年12月末 |
| 1 | 信用リスク | 39,200,698 | 38,765,342 | 3,309,537 | 3,272,682 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 931,759 | 921,643 | 74,540 | 73,731 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 36,141,999 | 35,719,844 | 3,064,841 | 3,029,042 |
| | 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 | 33,727 | 38,343 | 2,698 | 3,067 |
| | その他 | 2,093,211 | 2,085,511 | 167,456 | 166,840 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 3,825,833 | 4,284,556 | 312,680 | 349,599 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | — | — | — | — |
| | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分 | 1,158,550 | 1,187,569 | 98,186 | 100,647 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 2,341,070 | 2,754,557 | 187,285 | 220,364 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 91,236 | 90,681 | 7,298 | 7,254 |
| | その他 | 234,975 | 251,748 | 19,909 | 21,332 |
| 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 | 966,369 | 833,097 | 81,948 | 70,646 |
| 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） | 1,862,791 | 1,788,641 | 149,023 | 143,091 |
| 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） | — | — | — | — |
| | 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%） | 46,560 | 2,629 | 3,938 | 222 |
| | 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%） | 298,798 | 395,199 | 25,329 | 33,487 |
| 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%） | 23,404 | 25,963 | 1,872 | 2,077 |
| 11 | 未決済取引 | 8 | 95 | 0 | 8 |
| 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 | 1,250,740 | 1,088,345 | 100,059 | 87,067 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 1,037,083 | 929,402 | 82,966 | 74,352 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 196,459 | 141,736 | 15,716 | 11,338 |
| 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 | 17,198 | 17,205 | 1,375 | 1,376 |
| 16 | マーケット・リスク | 1,748,860 | 1,657,828 | 139,908 | 132,626 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 141,669 | 107,108 | 11,333 | 8,568 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,607,190 | 1,550,720 | 128,575 | 124,057 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 3,300,643 | 3,054,275 | 264,051 | 244,342 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 642,398 | 622,561 | 51,391 | 49,804 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | — | — | — | — |
| 22 | うち、先進的計測手法適用分 | 2,658,245 | 2,431,714 | 212,659 | 194,537 |
| 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 | 1,294,487 | 1,304,694 | 109,736 | 110,596 |
| | 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 | 3,645,118 | 3,181,811 | 291,609 | 254,544 |
| 25 | 合計（スケールリングファクター適用後） | 59,871,204 | 58,762,415 | 4,789,696 | 4,700,993 |