

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	
		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	38,955,356	38,428,985	3,297,806	3,253,067
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	37,786,994	37,239,218	3,204,337	3,157,885
	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	1,168,362	1,189,767	93,468	95,181
4	カウンターパーティ信用リスク	3,148,916	3,483,617	257,125	284,162
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	787,310	832,517	66,763	70,597
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,991,667	2,276,733	159,333	182,138
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	71,443	66,565	5,715	5,325
	その他	298,495	307,799	25,312	26,101
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	954,185	823,471	80,914	69,830
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）	1,851,352	1,768,253	148,108	141,460
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（マンドレート方式）	—	—	—	—
	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%）	40,298	441	3,417	37
	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%）	287,764	380,680	24,402	32,281
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%）	8,587	936	687	74
11	未決済取引	—	—	—	—
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	1,198,219	1,041,088	95,857	83,287
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,028,090	920,183	82,247	73,614
14	うち、外部格付準拠方式適用分	170,128	120,905	13,610	9,672
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	1,338,962	1,259,342	107,116	100,747
17	うち、標準的方式適用分	5,426	9,414	434	753
18	うち、内部モデル方式適用分	1,333,535	1,249,928	106,682	99,994
19	オペレーショナル・リスク	2,439,844	2,225,389	195,187	178,031
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
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	2,439,844	2,225,389	195,187	178,031
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	1,191,751	1,238,768	101,060	105,047
	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	2,987,416	1,991,192	238,993	159,295
25	合計（スケールリングファクター適用後）	56,883,463	55,091,541	4,550,677	4,407,323