

| OV1：リスク・アセットの概要 | | | | | |
|-----------------|--|------------|------------|-----------|-----------|
| 国際株式の 該当番号 | | イ | ロ | ハ | ニ |
| | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 2020年12月末 | 2020年9月末 | 2020年12月末 | 2020年9月末 |
| 1 | 信用リスク | 38,428,985 | 37,214,044 | 3,253,067 | 3,149,898 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | — | — | — | — |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 37,239,218 | 35,994,769 | 3,157,885 | 3,052,356 |
| | 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 | 1,189,767 | 1,219,275 | 95,181 | 97,542 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 3,483,617 | 3,555,243 | 284,162 | 289,763 |
| 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 | 832,517 | 852,043 | 70,597 | 72,253 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 2,276,733 | 2,373,992 | 182,138 | 189,919 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 66,565 | 67,895 | 5,325 | 5,431 |
| | その他 | 307,799 | 261,311 | 26,101 | 22,159 |
| 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 | 823,471 | 558,740 | 69,830 | 47,381 |
| 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） | 1,768,253 | 1,614,780 | 141,460 | 129,182 |
| 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%） | 441 | 450 | 37 | 38 |
| | 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%） | 380,680 | 355,385 | 32,281 | 30,136 |
| 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%） | 936 | — | 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 | 1,041,088 | 1,127,148 | 83,287 | 90,171 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 920,183 | 951,891 | 73,614 | 76,151 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 120,905 | 175,256 | 9,672 | 14,020 |
| 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 | 1,259,342 | 1,337,765 | 100,747 | 107,021 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 9,414 | 2,086 | 753 | 166 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,249,928 | 1,335,678 | 99,994 | 106,854 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 2,225,389 | 2,251,150 | 178,031 | 180,092 |
| 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 | 2,225,389 | 2,251,150 | 178,031 | 180,092 |
| 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 | 1,238,768 | 1,229,429 | 105,047 | 104,255 |
| | 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 | 1,991,192 | 1,971,544 | 159,295 | 157,723 |
| 25 | 合計（スケーリングファクター適用後） | 55,091,541 | 53,570,810 | 4,407,323 | 4,285,664 |