

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 | |
| | | 2022年3月末 | 2021年12月末 | 2022年3月末 | 2021年12月末 |
| 1 | 信用リスク | 41,710,522 | 40,494,747 | 3,521,026 | 3,418,746 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 971,367 | 923,794 | 77,709 | 73,903 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 38,371,815 | 37,326,397 | 3,253,929 | 3,165,278 |
| | 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 | 30,408 | 29,095 | 2,432 | 2,327 |
| | その他 | 2,336,931 | 2,215,459 | 186,954 | 177,236 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 3,964,465 | 3,858,686 | 324,435 | 315,417 |
| 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 | 1,302,103 | 1,155,736 | 110,357 | 97,945 |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | | | | |
| | うち、CVAリスク | 2,318,675 | 2,350,991 | 185,494 | 188,079 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 112,029 | 91,116 | 8,962 | 7,289 |
| | その他 | 231,657 | 260,843 | 19,621 | 22,103 |
| 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 | 874,084 | 1,254,924 | 74,122 | 106,417 |
| 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） | 2,195,559 | 2,016,105 | 175,644 | 161,288 |
| 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%） | 14,425 | 44,570 | 1,223 | 3,779 |
| | 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%） | 366,911 | 364,154 | 31,085 | 30,852 |
| 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%） | 89,694 | 37,298 | 7,175 | 2,983 |
| 11 | 未決済取引 | 113 | 11 | 9 | 1 |
| 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 | 1,409,040 | 1,303,313 | 112,723 | 104,265 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | 1,216,667 | 1,137,723 | 97,333 | 91,017 |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 168,987 | 145,498 | 13,519 | 11,639 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | 5,741 | | 459 | |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | 17,644 | 20,091 | 1,411 | 1,607 |
| 16 | マーケット・リスク | 2,212,808 | 2,683,833 | 177,024 | 214,706 |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | 241,525 | 276,344 | 19,322 | 22,107 |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | 1,971,282 | 2,407,488 | 157,702 | 192,599 |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 3,207,032 | 3,214,134 | 256,562 | 257,130 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 666,299 | 643,656 | 53,303 | 51,492 |
| 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 | 2,540,732 | 2,570,477 | 203,258 | 205,638 |
| 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 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 | 1,404,532 | 1,332,850 | 119,053 | 112,981 |
| 24 | フロア調整 | 6,119,406 | 5,303,056 | 489,552 | 424,244 |
| 25 | 合計（スケーリングファクター適用後） | 66,120,492 | 64,410,194 | 5,289,639 | 5,152,815 |