

## 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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	39,360,605	39,200,698	3,322,247	3,309,537
2	うち、標準的手法適用分	1,039,139	931,759	83,131	74,540
3	うち、内部格付手法適用分	36,124,793	36,141,999	3,063,382	3,064,841
	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	35,668	33,727	2,853	2,698
	その他	2,161,003	2,093,211	172,880	167,456
4	カウンターパーティ信用リスク	4,270,987	3,825,833	349,420	312,680
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	1,255,513	1,158,550	106,412	98,186
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,549,505	2,341,070	203,960	187,285
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	85,870	91,236	6,869	7,298
	その他	380,097	234,975	32,177	19,909
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	1,573,941	966,369	133,470	81,948
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）	2,221,735	1,862,791	177,738	149,023
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%）	46,628	46,560	3,943	3,938
	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%）	336,060	298,798	28,489	25,329
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%）	25,267	23,404	2,021	1,872
11	未決済取引	0	8	0	0
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	1,097,470	1,250,740	87,797	100,059
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	911,359	1,037,083	72,908	82,966
14	うち、外部格付準拠方式適用分	168,972	196,459	13,517	15,716
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	17,138	17,198	1,371	1,375
16	マーケット・リスク	1,921,587	1,748,860	153,726	139,908
17	うち、標準的方式適用分	197,921	141,669	15,833	11,333
18	うち、内部モデル方式適用分	1,723,666	1,607,190	137,893	128,575
19	オペレーショナル・リスク	3,249,696	3,300,643	259,975	264,051
20	うち、基礎的手法適用分	642,398	642,398	51,391	51,391
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	2,607,298	2,658,245	208,583	212,659
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	1,249,451	1,294,487	105,920	109,736
	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	3,985,313	3,645,118	318,825	291,609
25	合計（スケールリングファクター適用後）	61,794,715	59,871,204	4,943,577	4,789,696