

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	39,750,385	39,360,605	3,356,033	3,322,247
2	うち、標準的手法適用分	916,328	1,039,139	73,306	83,131
3	うち、内部格付手法適用分	36,667,315	36,124,793	3,109,388	3,063,382
	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	37,200	35,668	2,976	2,853
	その他	2,129,542	2,161,003	170,363	172,880
4	カウンターパーティ信用リスク	3,760,043	4,270,987	307,360	349,420
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	1,120,913	1,255,513	94,997	106,412
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,290,986	2,549,505	183,278	203,960
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	88,093	85,870	7,047	6,869
	その他	260,049	380,097	22,036	32,177
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	1,692,473	1,573,941	143,521	133,470
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）	2,107,221	2,221,735	168,577	177,738
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%）	44,371	46,628	3,762	3,943
	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%）	370,029	336,060	31,350	28,489
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%）	25,012	25,267	2,001	2,021
11	未決済取引	—	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	1,151,881	1,097,470	92,150	87,797
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	993,080	911,359	79,446	72,908
14	うち、外部格付準拠方式適用分	140,594	168,972	11,247	13,517
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	18,206	17,138	1,456	1,371
16	マーケット・リスク	2,112,475	1,921,587	168,998	153,726
17	うち、標準的方式適用分	197,101	197,921	15,768	15,833
18	うち、内部モデル方式適用分	1,915,373	1,723,666	153,229	137,893
19	オペレーショナル・リスク	3,204,799	3,249,696	256,383	259,975
20	うち、基礎的手法適用分	643,656	642,398	51,492	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	2,561,143	2,607,298	204,891	208,583
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	1,280,271	1,249,451	108,526	105,920
	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	4,255,519	3,985,313	340,441	318,825
25	合計（スケールリングファクター適用後）	62,238,855	61,794,715	4,979,108	4,943,577