

| OV1：リスク・アセットの概要 |  |            |            |           |           |
|-----------------|--|------------|------------|-----------|-----------|
| 国際様式の<br>該当番号   |  | イ          | ロ          | ハ         | ニ         |
|                 |  | 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  | 39,913,620 | 39,360,837 | 3,379,141 | 3,332,225 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 38,760,770 | 38,199,770 | 3,286,913 | 3,239,340 |
|                 | 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  | 1,152,850  | 1,161,066  | 92,228    | 92,885    |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,042,967  | 3,390,255  | 248,534   | 277,199   |
| 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                            | 753,752    | 819,157    | 63,918    | 69,464    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、CVAリスク  | 1,916,338  | 2,081,534  | 153,307   | 166,522   |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 64,800     | 63,106     | 5,184     | 5,048     |
|                 | その他  | 308,076    | 426,456    | 26,124    | 36,163    |
| 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                       | 1,680,986  | 1,562,999  | 142,547   | 132,542   |
| 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）      | 2,094,506  | 2,208,413  | 167,560   | 176,673   |
| 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%）      | 40,183     | 40,284     | 3,407     | 3,416     |
|                 | 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%）      | 354,766    | 324,479    | 30,084    | 27,515    |
| 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%） | 9,415      | 9,165      | 753       | 733       |
| 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               | 1,104,859  | 1,054,098  | 88,388    | 84,327    |
| 13              | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 972,262    | 898,021    | 77,780    | 71,841    |
| 14              | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 132,597    | 156,077    | 10,607    | 12,486    |
| 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  | 1,592,695  | 1,374,718  | 127,415   | 109,977   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 21,644     | 14,080     | 1,731     | 1,126     |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                                    | 1,571,051  | 1,360,637  | 125,684   | 108,851   |
| 19              | オペレーショナル・リスク                                     | 2,337,195  | 2,389,434  | 186,975   | 191,154   |
| 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                                    | 2,337,195  | 2,389,434  | 186,975   | 191,154   |
| 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                 | 727,624    | 1,092,929  | 61,702    | 92,680    |
|                 | 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  | 3,642,303  | 3,218,655  | 291,384   | 257,492   |
| 25              | 合計（スケールリングファクター適用後）                              | 59,098,693 | 58,574,236 | 4,727,895 | 4,685,938 |