

0V1：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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	40,494,747	39,750,385	3,418,746	3,356,033
2	うち、標準的手法適用分	923,794	916,328	73,903	73,306
3	うち、内部格付手法適用分	37,326,397	36,667,315	3,165,278	3,109,388
	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	29,095	37,200	2,327	2,976
	その他	2,215,459	2,129,542	177,236	170,363
4	カウンターパーティ信用リスク	3,858,686	3,760,043	315,417	307,360
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	1,155,736	1,120,913	97,945	94,997
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,350,991	2,290,986	188,079	183,278
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	91,116	88,093	7,289	7,047
	その他	260,843	260,049	22,103	22,036
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	1,254,924	1,692,473	106,417	143,521
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）	2,016,105	2,107,221	161,288	168,577
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%）	44,570	44,371	3,779	3,762
	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%）	364,154	370,029	30,852	31,350
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%）	37,298	25,012	2,983	2,001
11	未決済取引	11	—	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	1,303,313	1,151,881	104,265	92,150
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,137,723	993,080	91,017	79,446
14	うち、外部格付準拠方式適用分	145,498	140,594	11,639	11,247
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	20,091	18,206	1,607	1,456
16	マーケット・リスク	2,683,833	2,112,475	214,706	168,998
17	うち、標準的方式適用分	276,344	197,101	22,107	15,768
18	うち、内部モデル方式適用分	2,407,488	1,915,373	192,599	153,229
19	オペレーショナル・リスク	3,214,134	3,204,799	257,130	256,383
20	うち、基礎的手法適用分	643,656	643,656	51,492	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	2,570,477	2,561,143	205,638	204,891
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	1,332,850	1,280,271	112,981	108,526
	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	5,303,056	4,255,519	424,244	340,441
25	合計（スケールリングファクター適用後）	64,410,194	62,238,855	5,152,815	4,979,108