

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	40,242,760	39,913,620
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	39,088,174	38,760,770	3,314,677	3,286,913
	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	1,154,586	1,152,850	92,366	92,228
4	カウンターパーティ信用リスク	3,116,610	3,042,967	254,599	248,534
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	782,393	753,752	66,346	63,918
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,951,398	1,916,338	156,111	153,307
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	67,086	64,800	5,366	5,184
	その他	315,731	308,076	26,774	26,124
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	1,246,390	1,680,986	105,693	142,547
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）	2,002,666	2,094,506	160,213	167,560
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%）	40,401	40,183	3,426	3,407
	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%）	348,002	354,766	29,510	30,084
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	9,415	753	753
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	1,254,229	1,104,859	100,338	88,388
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,115,564	972,262	89,245	77,780
14	うち、外部格付準拠方式適用分	138,665	132,597	11,093	10,607
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	1,807,100	1,592,695	144,568	127,415
17	うち、標準的方式適用分	15,121	21,644	1,209	1,731
18	うち、内部モデル方式適用分	1,791,978	1,571,051	143,358	125,684
19	オペレーショナル・リスク	2,303,510	2,337,195	184,280	186,975
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	2,303,510	2,337,195	184,280	186,975
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	703,432	727,624	59,651	61,702
	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	4,817,609	3,642,303	385,408	291,384
25	合計（スケールリングファクター適用後）	60,443,600	59,098,693	4,835,488	4,727,895