

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	
		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	47,216,303	46,111,023	3,970,735	3,877,329
2	うち、標準的手法適用分	3,234,291	3,101,495	258,743	248,119
3	うち、内部格付手法適用分	40,298,246	39,259,992	3,417,291	3,329,247
	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	42,158	40,922	3,372	3,273
	その他	3,641,606	3,708,614	291,328	296,689
4	カウンターパーティ信用リスク	5,086,633	4,813,019	414,124	391,688
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	1,535,455	1,379,287	128,947	115,754
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,567,540	2,580,104	205,403	206,408
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	144,150	124,912	11,532	9,993
	その他	839,486	728,714	68,241	59,532
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	960,416	1,359,217	81,443	115,261
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）	2,209,787	2,033,982	176,783	162,718
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（マંデット方式）	—	—	—	—
	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%）	44,598	82,777	3,637	6,836
	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%）	413,050	415,450	34,836	35,008
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%）	189,538	106,558	15,163	8,524
11	未決済取引	113	11	9	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	1,409,040	1,303,313	112,723	104,265
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,216,667	1,137,723	97,333	91,017
14	うち、外部格付準拠方式適用分	168,987	145,498	13,519	11,639
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,741	—	459	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	17,644	20,091	1,411	1,607
16	マーケット・リスク	3,052,578	3,723,877	244,206	297,910
17	うち、標準的方式適用分	1,081,295	1,316,388	86,503	105,311
18	うち、内部モデル方式適用分	1,971,282	2,407,488	157,702	192,599
19	オペレーショナル・リスク	4,356,154	4,321,860	348,492	345,748
20	うち、基礎的手法適用分	970,096	916,592	77,607	73,327
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	3,386,058	3,405,267	270,884	272,421
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	2,937,560	2,616,831	248,567	221,687
	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	1,716,046	955,666	137,283	76,453
25	合計（スケーリングファクター適用後）	72,350,071	70,542,922	5,788,005	5,643,433