

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6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	44,391,752	44,181,371	3,734,775	3,717,776
2	うち、標準的手法適用分	2,850,799	2,797,587	228,063	223,806
3	うち、内部格付手法適用分	38,215,633	38,180,552	3,240,685	3,237,710
	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	47,608	45,567	3,808	3,645
	その他	3,277,711	3,157,664	262,216	252,613
4	カウンターパーティ信用リスク	5,091,508	4,822,842	414,976	392,354
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	1,443,964	1,338,017	121,403	112,463
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,755,139	2,549,322	220,411	203,945
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	111,251	119,017	8,900	9,521
	その他	781,153	816,484	64,261	66,423
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	1,701,183	1,084,489	144,260	91,964
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）	2,237,347	1,877,396	178,987	150,191
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%）	81,127	81,959	6,703	6,769
	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%）	387,381	356,365	32,615	29,955
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%）	103,445	88,989	8,275	7,119
11	未決済取引	0	8	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	1,097,470	1,250,740	87,797	100,059
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	911,359	1,037,083	72,908	82,966
14	うち、外部格付準拠方式適用分	168,972	196,459	13,517	15,716
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	17,138	17,198	1,371	1,375
16	マーケット・リスク	2,925,090	2,666,596	234,007	213,327
17	うち、標準的方式適用分	1,201,423	1,059,405	96,113	84,752
18	うち、内部モデル方式適用分	1,723,666	1,607,190	137,893	128,575
19	オペレーショナル・リスク	4,175,299	4,104,922	334,023	328,393
20	うち、基礎的手法適用分	897,054	897,054	71,764	71,764
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	3,278,245	3,207,868	262,259	256,629
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	2,314,732	2,355,212	196,254	199,683
	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	605,441	538,051	48,435	43,044
25	合計（スケーリングファクター適用後）	67,763,916	66,008,023	5,421,113	5,280,641