

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際株式の 該当番号		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	44,863,096	44,391,752	3,774,185	3,734,775
2	うち、標準的手法適用分	2,951,081	2,850,799	236,086	228,063
3	うち、内部格付手法適用分	38,570,425	38,215,633	3,270,772	3,240,685
	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値のエクスポージャー	49,121	47,608	3,929	3,808
	その他	3,292,467	3,277,711	263,397	262,216
4	カウンターパーティ信用リスク	4,765,228	5,091,508	387,694	414,976
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	1,324,642	1,443,964	111,221	121,403
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,509,164	2,755,139	200,733	220,411
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	114,359	111,251	9,148	8,900
	その他	817,062	781,153	66,590	64,261
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	1,822,269	1,701,183	154,528	144,260
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（レック・スルー方式）	2,123,410	2,237,347	169,872	178,987
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%）	84,823	81,127	6,998	6,703
	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%）	428,119	387,381	36,076	32,615
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%）	87,461	103,445	6,996	8,275
11	未決済取引	—	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	1,151,881	1,097,470	92,150	87,797
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	993,080	911,359	79,446	72,908
14	うち、外部格付準拠方式適用分	140,594	168,972	11,247	13,517
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	18,206	17,138	1,456	1,371
16	マーケット・リスク	3,338,111	2,925,090	267,048	234,007
17	うち、標準的方式適用分	1,422,738	1,201,423	113,819	96,113
18	うち、内部モデル方式適用分	1,915,373	1,723,666	153,229	137,893
19	オペレーショナル・リスク	4,271,331	4,175,299	341,706	334,023
20	うち、基礎的手法適用分	916,592	897,054	73,327	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	3,354,738	3,278,245	268,379	262,259
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	2,388,167	2,314,732	202,473	196,254
	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	692,746	605,441	55,419	48,435
25	合計（スケーリングファクター適用後）	68,689,415	67,763,916	5,495,153	5,421,113