

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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	46,111,023	44,863,096	3,877,329	3,774,185
2	うち、標準的手法適用分	3,101,495	2,951,081	248,119	236,086
3	うち、内部格付手法適用分	39,259,992	38,570,425	3,329,247	3,270,772
	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	40,922	49,121	3,273	3,929
	その他	3,708,614	3,292,467	296,689	263,397
4	カウンターパーティ信用リスク	4,813,019	4,765,228	391,688	387,694
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	1,379,287	1,324,642	115,754	111,221
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,580,104	2,509,164	206,408	200,733
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	124,912	114,359	9,993	9,148
	その他	728,714	817,062	59,532	66,590
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	1,359,217	1,822,269	115,261	154,528
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）	2,033,982	2,123,410	162,718	169,872
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（マデント方式）	—	—	—	—
	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%）	82,777	84,823	6,836	6,998
	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%）	415,450	428,119	35,008	36,076
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%）	106,558	87,461	8,524	6,996
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	3,723,877	3,338,111	297,910	267,048
17	うち、標準的方式適用分	1,316,388	1,422,738	105,311	113,819
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	4,321,860	4,271,331	345,748	341,706
20	うち、基礎的手法適用分	916,592	916,592	73,327	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	3,405,267	3,354,738	272,421	268,379
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	2,616,831	2,388,167	221,687	202,473
	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	955,666	692,746	76,453	55,419
25	合計（スケーリングファクター適用後）	70,542,922	68,689,415	5,643,433	5,495,153