

## OV1：リスク・アセットの概要

| 国際様式の<br>該当番号 |                                                  | イ          | ロ          | ハ         | ニ         |
|---------------|--------------------------------------------------|------------|------------|-----------|-----------|
|               |                                                  | リスク・アセット   |            | 所要自己資本    |           |
|               |                                                  | 2023年3月末   | 2022年12月末  | 2023年3月末  | 2022年12月末 |
| 1             | 信用リスク                                            | 48,133,282 | 48,554,333 | 4,043,801 | 4,079,527 |
| 2             | うち、標準的手法適用分                                      | 3,650,094  | 3,581,283  | 292,007   | 286,502   |
| 3             | うち、内部格付手法適用分                                     | 40,237,209 | 40,662,683 | 3,412,115 | 3,448,195 |
|               | 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                      | 36,042     | 39,933     | 2,883     | 3,194     |
|               | その他                                              | 4,209,936  | 4,270,433  | 336,794   | 341,634   |
| 4             | カウンターパーティ信用リスク                                   | 5,247,547  | 5,532,271  | 427,703   | 451,099   |
| 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                            | 1,503,981  | 1,649,897  | 126,501   | 138,668   |
| 6             | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          | —          | —         | —         |
|               | うち、CVAリスク                                        | 2,594,370  | 2,764,732  | 207,549   | 221,178   |
|               | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 284,745    | 247,975    | 22,779    | 19,838    |
|               | その他                                              | 864,450    | 869,666    | 70,872    | 71,414    |
| 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                       | 847,614    | 538,831    | 71,877    | 45,692    |
| 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）      | 2,550,305  | 2,202,660  | 204,024   | 176,212   |
| 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％）      | 85,894     | 75,062     | 7,083     | 6,066     |
|               | 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％）      | 550,764    | 616,420    | 45,946    | 51,930    |
| 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％） | 271,158    | 313,473    | 21,692    | 25,077    |
| 11            | 未決済取引                                            | 255        | 442        | 21        | 37        |
| 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               | 1,311,406  | 1,477,615  | 104,912   | 118,209   |
| 13            | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 1,074,905  | 1,195,287  | 85,992    | 95,623    |
| 14            | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 218,204    | 262,870    | 17,456    | 21,029    |
| 15            | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 4,111      | 4,710      | 328       | 376       |
|               | うち、1250％のリスク・ウェイト適用分                             | 14,184     | 14,746     | 1,134     | 1,179     |
| 16            | マーケット・リスク                                        | 4,474,842  | 3,943,251  | 357,987   | 315,460   |
| 17            | うち、標準的方式適用分                                      | 1,607,836  | 911,795    | 128,626   | 72,943    |
| 18            | うち、内部モデル方式適用分                                    | 2,867,006  | 3,031,456  | 229,360   | 242,516   |
| 19            | オペレーショナル・リスク                                     | 4,870,622  | 4,618,074  | 389,649   | 369,445   |
| 20            | うち、基礎的手法適用分                                      | 1,112,261  | 1,045,512  | 88,980    | 83,641    |
| 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                                    | 3,758,360  | 3,572,562  | 300,668   | 285,804   |
| 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                 | 3,239,127  | 3,605,585  | 273,891   | 304,397   |
|               | 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                                            | 2,927,635  | 2,735,780  | 234,210   | 218,862   |
| 25            | 合計（スケーリングファクター適用後）                               | 77,285,048 | 77,025,261 | 6,182,803 | 6,162,020 |