

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6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	49,166,024	47,216,303	4,135,228	3,970,735
2	うち、標準的手法適用分	3,358,401	3,234,291	268,672	258,743
3	うち、内部格付手法適用分	42,072,117	40,298,246	3,567,715	3,417,291
	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	38,576	42,158	3,086	3,372
	その他	3,696,929	3,641,606	295,754	291,328
4	カウンターパーティ信用リスク	5,361,086	5,086,633	436,962	414,124
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	1,678,386	1,535,455	141,011	128,947
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,662,700	2,567,540	213,016	205,403
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	187,016	144,150	14,961	11,532
	その他	832,982	839,486	67,974	68,241
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	1,060,128	960,416	89,898	81,443
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）	2,158,856	2,209,787	172,708	176,783
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％）	48,752	44,598	3,974	3,637
	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％）	503,825	413,050	42,475	34,836
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％）	192,225	189,538	15,378	15,163
11	未決済取引	253	113	21	9
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	1,391,389	1,409,040	111,311	112,723
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,166,833	1,216,667	93,346	97,333
14	うち、外部格付準拠方式適用分	203,785	168,987	16,302	13,519
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	5,163	5,741	413	459
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	15,606	17,644	1,248	1,411
16	マーケット・リスク	3,515,298	3,052,578	281,223	244,206
17	うち、標準的方式適用分	1,081,884	1,081,295	86,550	86,503
18	うち、内部モデル方式適用分	2,433,414	1,971,282	194,673	157,702
19	オペレーショナル・リスク	4,313,509	4,356,154	345,080	348,492
20	うち、基礎的手法適用分	970,096	970,096	77,607	77,607
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	3,343,413	3,386,058	267,473	270,884
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	3,346,205	2,937,560	282,721	248,567
	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	2,493,914	1,716,046	199,513	137,283
25	合計（スケーリングファクター適用後）	76,456,234	72,350,071	6,116,498	5,788,005