

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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	48,715,646	49,166,024	4,095,161	4,135,228
2	うち、標準的手法適用分	3,513,362	3,358,401	281,068	268,672
3	うち、内部格付手法適用分	41,231,157	42,072,117	3,496,402	3,567,715
	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	35,369	38,576	2,829	3,086
	その他	3,935,756	3,696,929	314,860	295,754
4	カウンターパーティ信用リスク	6,008,371	5,361,086	490,092	436,962
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	1,959,260	1,678,386	164,886	141,011
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	3,105,198	2,662,700	248,415	213,016
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	209,273	187,016	16,741	14,961
	その他	734,638	832,982	60,048	67,974
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	651,569	1,060,128	55,253	89,898
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）	2,341,841	2,158,856	187,347	172,708
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％）	50,996	48,752	4,136	3,974
	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％）	615,171	503,825	51,656	42,475
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％）	206,480	192,225	16,518	15,378
11	未決済取引	1,832	253	155	21
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	1,509,852	1,391,389	120,788	111,311
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,196,657	1,166,833	95,732	93,346
14	うち、外部格付準拠方式適用分	292,750	203,785	23,420	16,302
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,872	5,163	389	413
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	15,571	15,606	1,245	1,248
16	マーケット・リスク	3,691,340	3,515,298	295,307	281,223
17	うち、標準的方式適用分	897,668	1,081,884	71,813	86,550
18	うち、内部モデル方式適用分	2,793,671	2,433,414	223,493	194,673
19	オペレーショナル・リスク	4,569,003	4,313,509	365,520	345,080
20	うち、基礎的手法適用分	1,045,512	970,096	83,641	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	3,523,491	3,343,413	281,879	267,473
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	3,608,766	3,346,205	304,665	282,721
	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	3,138,873	2,493,914	251,109	199,513
25	合計（スケーリングファクター適用後）	77,971,394	76,456,234	6,237,711	6,116,498