

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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	48,554,333	48,715,646	4,079,527	4,095,161
2	うち、標準的手法適用分	3,581,283	3,513,362	286,502	281,068
3	うち、内部格付手法適用分	40,662,683	41,231,157	3,448,195	3,496,402
	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	39,933	35,369	3,194	2,829
	その他	4,270,433	3,935,756	341,634	314,860
4	カウンターパーティ信用リスク	5,532,271	6,008,371	451,099	490,092
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	1,649,897	1,959,260	138,668	164,886
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,764,732	3,105,198	221,178	248,415
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	247,975	209,273	19,838	16,741
	その他	869,666	734,638	71,414	60,048
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	538,831	651,569	45,692	55,253
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）	2,202,660	2,341,841	176,212	187,347
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％）	75,062	50,996	6,066	4,136
	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％）	616,420	615,171	51,930	51,656
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％）	313,473	206,480	25,077	16,518
11	未決済取引	442	1,832	37	155
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	1,477,615	1,509,852	118,209	120,788
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,195,287	1,196,657	95,623	95,732
14	うち、外部格付準拠方式適用分	262,870	292,750	21,029	23,420
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	4,710	4,872	376	389
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	14,746	15,571	1,179	1,245
16	マーケット・リスク	3,943,251	3,691,340	315,460	295,307
17	うち、標準的方式適用分	911,795	897,668	72,943	71,813
18	うち、内部モデル方式適用分	3,031,456	2,793,671	242,516	223,493
19	オペレーショナル・リスク	4,618,074	4,569,003	369,445	365,520
20	うち、基礎的手法適用分	1,045,512	1,045,512	83,641	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	3,572,562	3,523,491	285,804	281,879
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	3,605,585	3,608,766	304,397	304,665
	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	2,735,780	3,138,873	218,862	251,109
25	合計（スケーリングファクター適用後）	77,025,261	77,971,394	6,162,020	6,237,711