

| 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12月末  | 2023年9月末   | 2023年12月末 | 2023年9月末  |
| 1               | 信用リスク                                            | 41,880,637 | 42,632,458 | 3,544,460 | 3,607,909 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                                     | 40,418,657 | 41,106,853 | 3,427,502 | 3,485,861 |
|                 | 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                      | —          | —          | —         | —         |
|                 | その他                                              | 1,461,979  | 1,525,604  | 116,958   | 122,048   |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                                   | 3,085,771  | 3,564,944  | 252,708   | 291,561   |
| 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                            | 857,896    | 965,379    | 72,749    | 81,864    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、CVAリスク                                        | 1,760,551  | 2,129,088  | 140,844   | 170,327   |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 107,175    | 109,684    | 8,574     | 8,774     |
|                 | その他                                              | 360,147    | 360,792    | 30,540    | 30,595    |
| 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                       | 1,583,421  | 1,455,602  | 134,274   | 123,435   |
| 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）      | 3,448,840  | 3,393,368  | 275,907   | 271,469   |
| 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％）      | 43,517     | 57,294     | 3,690     | 4,858     |
|                 | 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％）      | 723,468    | 687,518    | 61,350    | 58,301    |
| 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％） | 104,481    | 101,734    | 8,358     | 8,138     |
| 11              | 未決済取引                                            | —          | —          | —         | —         |
| 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               | 1,243,466  | 1,269,041  | 99,477    | 101,523   |
| 13              | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 1,059,277  | 1,048,748  | 84,742    | 83,899    |
| 14              | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 181,480    | 217,218    | 14,518    | 17,377    |
| 15              | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | 2,708      | 3,074      | 216       | 245       |
|                 | うち、1250％のリスク・ウェイト適用分                             | —          | —          | —         | —         |
| 16              | マーケット・リスク                                        | 1,486,589  | 1,396,547  | 118,927   | 111,723   |
| 17              | うち、標準的方式適用分                                      | 14,952     | 12,516     | 1,196     | 1,001     |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                                    | 1,471,636  | 1,384,031  | 117,730   | 110,722   |
| 19              | オペレーショナル・リスク                                     | 2,715,316  | 2,633,511  | 217,225   | 210,680   |
| 20              | うち、基礎的手法適用分                                      | —          | —          | —         | —         |
| 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                                    | 2,715,316  | 2,633,511  | 217,225   | 210,680   |
| 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                 | 1,408,672  | 979,896    | 119,455   | 83,095    |
|                 | 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                                            | 8,845,979  | 9,218,480  | 707,678   | 737,478   |
| 25              | 合計（スケーリングファクター適用後）                               | 69,293,909 | 70,127,199 | 5,543,512 | 5,610,175 |