

## 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                                            | 51,660,375 | 51,181,869 | 4,338,292 | 4,299,171 |
| 2             | うち、標準的手法適用分                                      | 4,255,538  | 4,128,952  | 340,443   | 330,316   |
| 3             | うち、内部格付手法適用分                                     | 42,804,763 | 42,629,651 | 3,629,843 | 3,614,994 |
|               | 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                      | 34,779     | 35,251     | 2,782     | 2,820     |
|               | その他                                              | 4,565,293  | 4,388,014  | 365,223   | 351,041   |
| 4             | カウンターパーティ信用リスク                                   | 5,266,833  | 5,748,057  | 429,643   | 468,745   |
| 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                            | 1,596,891  | 1,736,111  | 134,365   | 146,083   |
| 6             | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | —          | —          | —         | —         |
|               | うち、CVAリスク                                        | 2,539,372  | 2,716,425  | 203,149   | 217,314   |
|               | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 338,403    | 391,476    | 27,072    | 31,318    |
|               | その他                                              | 792,166    | 904,043    | 65,056    | 74,030    |
| 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                       | 1,758,270  | 1,614,272  | 149,101   | 136,890   |
| 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）      | 3,481,884  | 3,426,634  | 278,550   | 274,130   |
| 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％）      | 118,360    | 130,115    | 9,681     | 10,688    |
|               | 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％）      | 905,808    | 878,138    | 76,012    | 73,630    |
| 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％） | 280,177    | 247,586    | 22,414    | 19,806    |
| 11            | 未決済取引                                            | 8          | 32         | 0         | 2         |
| 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               | 1,304,026  | 1,327,517  | 104,322   | 106,201   |
| 13            | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分                         | 1,099,385  | 1,086,171  | 87,950    | 86,893    |
| 14            | うち、外部格付準拠方式適用分                                   | 187,741    | 224,076    | 15,019    | 17,926    |
| 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                             | 14,191     | 14,195     | 1,135     | 1,135     |
| 16            | マーケット・リスク                                        | 3,691,711  | 3,613,364  | 295,336   | 289,069   |
| 17            | うち、標準的方式適用分                                      | 1,484,171  | 1,548,018  | 118,733   | 123,841   |
| 18            | うち、内部モデル方式適用分                                    | 2,207,539  | 2,065,345  | 176,603   | 165,227   |
| 19            | オペレーショナル・リスク                                     | 5,167,475  | 5,059,369  | 413,398   | 404,749   |
| 20            | うち、基礎的手法適用分                                      | 1,158,203  | 1,158,203  | 92,656    | 92,656    |
| 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                                    | 4,009,271  | 3,901,165  | 320,741   | 312,093   |
| 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                 | 3,042,373  | 3,259,610  | 257,792   | 275,912   |
|               | 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                                            | 1,931,206  | 2,553,512  | 154,496   | 204,281   |
| 25            | 合計（スケーリングファクター適用後）                               | 81,613,040 | 82,040,996 | 6,529,043 | 6,563,279 |