

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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	36,266,480	36,567,583	3,059,650	3,084,439
2	うち、標準的手法適用分	1,157,276	979,651	92,582	78,372
3	うち、内部格付手法適用分	32,985,913	33,131,926	2,797,205	2,809,587
	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	35,451	35,820	2,836	2,865
	その他	2,087,839	2,420,184	167,027	193,614
4	カウンターパーティ信用リスク	4,404,773	3,623,489	358,978	295,614
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	1,223,730	1,011,323	103,680	85,701
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,824,229	2,273,916	225,938	181,913
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	180,278	139,545	14,422	11,163
	その他	176,533	198,703	14,937	16,836
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	735,052	653,403	62,332	55,408
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）	1,751,561	2,103,323	140,124	168,265
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（マドレー方式）	—	—	—	—
	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%）	2,397	2,421	203	205
	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%）	349,943	346,059	29,675	29,345
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%）	15,348	15,208	1,227	1,216
11	未決済取引	10	—	0	—
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	1,153,950	1,104,197	92,316	88,335
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,020,034	964,338	81,602	77,147
14	うち、外部格付準拠方式適用分	118,792	126,716	9,503	10,137
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	15,123	13,142	1,209	1,051
16	マーケット・リスク	1,791,994	1,613,687	143,359	129,095
17	うち、標準的方式適用分	107,579	161,267	8,606	12,901
18	うち、内部モデル方式適用分	1,684,414	1,452,420	134,753	116,193
19	オペレーショナル・リスク	3,154,969	3,010,698	252,397	240,855
20	うち、基礎的手法適用分	607,569	602,168	48,605	48,173
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	2,547,400	2,408,529	203,792	192,682
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	1,404,236	1,429,209	119,079	121,196
	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	2,711,973	2,871,151	216,957	229,692
25	合計（スケールリングファクター適用後）	55,953,809	55,545,910	4,476,304	4,443,672