

0V1：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	35,870,047	35,976,466	3,035,954	3,043,556
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	34,656,287	34,466,447	2,938,853	2,922,754
	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	1,213,760	1,510,018	97,100	120,801
4	カウンターパーティ信用リスク	3,469,201	2,738,452	282,527	223,601
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	836,198	692,950	70,909	58,762
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,323,788	1,713,706	185,903	137,096
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	105,523	81,982	8,441	6,558
	その他	203,690	249,813	17,272	21,184
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	722,410	639,325	61,260	54,214
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）	1,740,955	2,087,941	139,276	167,035
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%）	449	451	38	38
	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%）	337,560	339,458	28,625	28,786
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%）	—	—	—	—
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	1,122,238	1,075,859	89,779	86,068
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,013,713	957,266	81,097	76,581
14	うち、外部格付準拠方式適用分	108,524	118,593	8,681	9,487
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	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	1,401,101	1,209,076	112,088	96,726
17	うち、標準的方式適用分	1,507	8,653	120	692
18	うち、内部モデル方式適用分	1,399,594	1,200,422	111,967	96,033
19	オペレーショナル・リスク	2,323,176	2,169,874	185,854	173,589
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	2,323,176	2,169,874	185,854	173,589
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	1,229,740	1,299,847	104,282	110,227
	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	1,752,812	2,229,531	140,225	178,362
25	合計（スケーリングファクター適用後）	52,248,875	52,027,582	4,179,910	4,162,206