

0V1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	34,680,483	34,232,760	2,934,767	2,897,120
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	33,401,853	33,020,697	2,832,477	2,800,155
	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	1,278,630	1,212,062	102,290	96,965
4	カウンターパーティ信用リスク	2,715,951	2,536,826	221,340	206,744
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	650,115	587,207	55,129	49,795
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,779,707	1,645,484	142,376	131,638
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	89,568	100,015	7,165	8,001
	その他	196,558	204,117	16,668	17,309
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	687,708	844,840	58,317	71,642
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）	2,291,109	2,085,768	183,288	166,861
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%）	613	632	52	53
	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%）	311,706	297,517	26,432	25,229
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	1,109,879	1,112,245	88,790	88,979
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	963,736	960,799	77,098	76,863
14	うち、外部格付準拠方式適用分	146,142	151,446	11,691	12,115
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	1,235,772	1,234,863	98,861	98,789
17	うち、標準的方式適用分	6,764	2,831	541	226
18	うち、内部モデル方式適用分	1,229,007	1,232,032	98,320	98,562
19	オペレーショナル・リスク	2,046,192	2,060,777	163,695	164,862
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	2,046,192	2,060,777	163,695	164,862
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	1,301,283	1,290,164	110,348	109,405
	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	1,350,241	1,703,411	108,019	136,272
25	合計（スケーリングファクター適用後）	49,923,932	49,574,518	3,993,914	3,965,961