

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	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	35,099,533	35,723,440	2,960,768	3,012,458
2	うち、標準的手法適用分	965,336	1,004,639	77,226	80,371
3	うち、内部格付手法適用分	31,834,533	32,204,859	2,699,568	2,730,972
	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	39,218	42,688	3,137	3,415
	その他	2,260,445	2,471,252	180,835	197,700
4	カウンターパーティ信用リスク	3,749,850	3,485,517	305,651	284,050
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	1,036,213	965,932	87,802	81,840
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,408,396	2,219,793	192,671	177,583
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	144,940	139,585	11,595	11,166
	その他	160,299	160,205	13,582	13,459
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	718,825	700,629	60,956	59,413
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）	2,199,348	2,302,352	175,947	184,188
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（マナドート方式）	—	—	—	—
	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%）	2,552	4,787	216	405
	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%）	327,382	311,715	27,762	26,433
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%）	15,077	15,311	1,206	1,224
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	1,073,070	1,131,645	85,845	90,531
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	928,234	970,815	74,258	77,665
14	うち、外部格付準拠方式適用分	133,156	152,270	10,652	12,181
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	11,679	8,559	934	684
16	マーケット・リスク	1,861,763	1,773,955	148,941	141,916
17	うち、標準的方式適用分	178,933	162,884	14,314	13,030
18	うち、内部モデル方式適用分	1,682,830	1,611,070	134,626	128,885
19	オペレーショナル・リスク	3,018,677	2,839,406	241,494	227,152
20	うち、基礎的手法適用分	602,168	561,790	48,173	44,943
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	2,416,508	2,277,615	193,320	182,209
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	1,400,409	1,430,200	118,754	121,280
	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	2,132,739	1,777,877	170,619	142,230
25	合計（スケールリングファクター適用後）	53,727,051	53,641,083	4,298,164	4,291,286