

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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	34,835,705	34,680,483	2,947,579	2,934,767
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	33,484,005	33,401,853	2,839,443	2,832,477
	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	1,351,700	1,278,630	108,136	102,290
4	カウンターパーティ信用リスク	2,947,242	2,715,951	240,202	221,340
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	696,883	650,115	59,095	55,129
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,935,285	1,779,707	154,822	142,376
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	90,452	89,568	7,236	7,165
	その他	224,620	196,558	19,047	16,668
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	705,291	687,708	59,808	58,317
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）	2,189,150	2,291,109	175,132	183,288
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%）	578	613	49	52
	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%）	320,919	311,706	27,214	26,432
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	1,049,210	1,109,879	83,936	88,790
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	921,070	963,736	73,685	77,098
14	うち、外部格付準拠方式適用分	128,140	146,142	10,251	11,691
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	1,303,306	1,235,772	104,264	98,861
17	うち、標準的方式適用分	6,202	6,764	496	541
18	うち、内部モデル方式適用分	1,297,104	1,229,007	103,768	98,320
19	オペレーショナル・リスク	2,183,543	2,046,192	174,683	163,695
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	2,183,543	2,046,192	174,683	163,695
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	1,300,990	1,301,283	110,323	110,348
	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	1,551,504	1,350,241	124,120	108,019
25	合計（スケールリングファクター適用後）	50,591,441	49,923,932	4,047,315	3,993,914