

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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	36,567,583	35,099,533	3,084,439	2,960,768
2	うち、標準的手法適用分	979,651	965,336	78,372	77,226
3	うち、内部格付手法適用分	33,131,926	31,834,533	2,809,587	2,699,568
	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	35,820	39,218	2,865	3,137
	その他	2,420,184	2,260,445	193,614	180,835
4	カウンターパーティ信用リスク	3,623,489	3,749,850	295,614	305,651
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	1,011,323	1,036,213	85,701	87,802
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,273,916	2,408,396	181,913	192,671
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	139,545	144,940	11,163	11,595
	その他	198,703	160,299	16,836	13,582
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	653,403	718,825	55,408	60,956
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）	2,103,323	2,199,348	168,265	175,947
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%）	2,421	2,552	205	216
	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%）	346,059	327,382	29,345	27,762
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%）	15,208	15,077	1,216	1,206
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	1,104,197	1,073,070	88,335	85,845
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	964,338	928,234	77,147	74,258
14	うち、外部格付準拠方式適用分	126,716	133,156	10,137	10,652
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	13,142	11,679	1,051	934
16	マーケット・リスク	1,613,687	1,861,763	129,095	148,941
17	うち、標準的方式適用分	161,267	178,933	12,901	14,314
18	うち、内部モデル方式適用分	1,452,420	1,682,830	116,193	134,626
19	オペレーショナル・リスク	3,010,698	3,018,677	240,855	241,494
20	うち、基礎的手法適用分	602,168	602,168	48,173	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	2,408,529	2,416,508	192,682	193,320
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	1,429,209	1,400,409	121,196	118,754
	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	2,871,151	2,132,739	229,692	170,619
25	合計（スケーリングファクター適用後）	55,545,910	53,727,051	4,443,672	4,298,164