

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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	35,976,466	34,835,705	3,043,556	2,947,579
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	34,466,447	33,484,005	2,922,754	2,839,443
	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	1,510,018	1,351,700	120,801	108,136
4	カウンターパーティ信用リスク	2,738,452	2,947,242	223,601	240,202
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	692,950	696,883	58,762	59,095
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,713,706	1,935,285	137,096	154,822
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	81,982	90,452	6,558	7,236
	その他	249,813	224,620	21,184	19,047
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	639,325	705,291	54,214	59,808
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）	2,087,941	2,189,150	167,035	175,132
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%）	451	578	38	49
	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%）	339,458	320,919	28,786	27,214
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	1,075,859	1,049,210	86,068	83,936
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	957,266	921,070	76,581	73,685
14	うち、外部格付準拠方式適用分	118,593	128,140	9,487	10,251
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	1,209,076	1,303,306	96,726	104,264
17	うち、標準的方式適用分	8,653	6,202	692	496
18	うち、内部モデル方式適用分	1,200,422	1,297,104	96,033	103,768
19	オペレーショナル・リスク	2,169,874	2,183,543	173,589	174,683
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	2,169,874	2,183,543	173,589	174,683
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	1,299,847	1,300,990	110,227	110,323
	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	2,229,531	1,551,504	178,362	124,120
25	合計（スケーリングファクター適用後）	52,027,582	50,591,441	4,162,206	4,047,315