

OV1：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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	40,936,349	41,531,822	3,442,320	3,491,716
2	うち、標準的手法適用分	3,050,149	2,850,048	244,011	228,003
3	うち、内部格付手法適用分	34,877,672	35,243,821	2,957,626	2,988,676
	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	46,881	46,965	3,750	3,757
	その他	2,961,646	3,390,986	236,931	271,278
4	カウンターパーティ信用リスク	5,382,967	4,603,891	437,131	373,931
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	1,495,568	1,257,368	125,330	105,310
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	3,067,315	2,643,352	245,385	211,468
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	213,245	170,524	17,059	13,641
	その他	606,838	532,646	49,356	43,510
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	789,942	720,380	66,987	61,088
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）	1,766,889	2,118,307	141,351	169,464
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（マデラート方式）	—	—	—	—
	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%）	41,242	39,448	3,310	3,167
	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%）	375,427	384,642	31,730	32,448
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%）	59,012	27,551	4,720	2,204
11	未決済取引	10	—	0	—
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	1,153,950	1,104,197	92,316	88,335
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,020,034	964,338	81,602	77,147
14	うち、外部格付準拠方式適用分	118,792	126,716	9,503	10,137
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	15,123	13,142	1,209	1,051
16	マーケット・リスク	2,509,994	2,420,045	200,799	193,603
17	うち、標準的方式適用分	825,580	967,625	66,046	77,410
18	うち、内部モデル方式適用分	1,684,414	1,452,420	134,753	116,193
19	オペレーショナル・リスク	3,924,796	3,815,792	313,983	305,263
20	うち、基礎的手法適用分	839,490	831,888	67,159	66,551
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	3,085,305	2,983,904	246,824	238,712
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	2,279,392	2,324,950	193,271	197,139
	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	—	—	—	—
25	合計（スケーリングファクター適用後）	61,599,066	61,479,534	4,927,925	4,918,362