

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	
		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	41,531,822	39,860,351	3,491,716	3,351,284
2	うち、標準的手法適用分	2,850,048	2,791,755	228,003	223,340
3	うち、内部格付手法適用分	35,243,821	33,845,124	2,988,676	2,870,066
	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	46,965	49,933	3,757	3,994
	その他	3,390,986	3,173,538	271,278	253,883
4	カウンターパーティ信用リスク	4,603,891	4,805,917	373,931	390,046
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	1,257,368	1,279,508	105,310	107,180
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,643,352	2,765,725	211,468	221,258
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	170,524	181,046	13,641	14,483
	その他	532,646	579,638	43,510	47,124
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	720,380	783,272	61,088	66,421
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）	2,118,307	2,213,131	169,464	177,050
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（マデット方式）	—	—	—	—
	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%）	39,448	38,472	3,167	3,090
	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%）	384,642	358,487	32,448	30,267
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%）	27,551	28,449	2,204	2,275
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	2,420,045	2,535,344	193,603	202,827
17	うち、標準的方式適用分	967,625	852,514	77,410	68,201
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	3,815,792	3,747,389	305,263	299,791
20	うち、基礎的手法適用分	831,888	831,888	66,551	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	2,983,904	2,915,500	238,712	233,240
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	2,324,950	2,255,407	197,139	191,247
	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（スケールリングファクター適用後）	61,479,534	60,001,868	4,918,362	4,800,149