

0V1：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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	37,709,754	36,266,480	3,182,787	3,059,650
2	うち、標準的手法適用分	953,810	1,157,276	76,304	92,582
3	うち、内部格付手法適用分	34,584,832	32,985,913	2,932,793	2,797,205
	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	37,652	35,451	3,012	2,836
	その他	2,133,459	2,087,839	170,676	167,027
4	カウンターパーティ信用リスク	4,287,226	4,404,773	349,631	358,978
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	1,190,893	1,223,730	100,909	103,680
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,735,639	2,824,229	218,851	225,938
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	139,714	180,278	11,177	14,422
	その他	220,978	176,533	18,694	14,937
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	689,686	735,052	58,485	62,332
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）	1,649,732	1,751,561	131,978	140,124
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%）	2,662	2,397	225	203
	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%）	302,715	349,943	25,670	29,675
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%）	16,461	15,348	1,316	1,227
11	未決済取引	1	10	0	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	1,153,444	1,153,950	92,275	92,316
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,004,311	1,020,034	80,344	81,602
14	うち、外部格付準拠方式適用分	134,547	118,792	10,763	9,503
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	14,585	15,123	1,166	1,209
16	マーケット・リスク	1,681,737	1,791,994	134,538	143,359
17	うち、標準的方式適用分	141,302	107,579	11,304	8,606
18	うち、内部モデル方式適用分	1,540,434	1,684,414	123,234	134,753
19	オペレーショナル・リスク	3,158,925	3,154,969	252,714	252,397
20	うち、基礎的手法適用分	607,569	607,569	48,605	48,605
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	2,551,356	2,547,400	204,108	203,792
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	1,373,863	1,404,236	116,503	119,079
	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	2,995,592	2,711,973	239,647	216,957
25	合計（スケーリングファクター適用後）	57,322,204	55,953,809	4,585,776	4,476,304