

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	
		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	37,212,984	35,870,047	3,149,739	3,035,954
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	35,979,330	34,656,287	3,051,047	2,938,853
	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	1,233,653	1,213,760	98,692	97,100
4	カウンターパーティ信用リスク	3,482,911	3,469,201	283,925	282,527
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	842,642	836,198	71,456	70,909
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,275,729	2,323,788	182,058	185,903
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	104,505	105,523	8,360	8,441
	その他	260,033	203,690	22,050	17,272
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	676,927	722,410	57,403	61,260
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）	1,639,208	1,740,955	131,136	139,276
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%）	444	449	37	38
	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%）	293,278	337,560	24,870	28,625
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%）	972	—	77	—
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	1,116,481	1,122,238	89,318	89,779
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	995,840	1,013,713	79,667	81,097
14	うち、外部格付準拠方式適用分	120,640	108,524	9,651	8,681
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	1,281,146	1,401,101	102,491	112,088
17	うち、標準的方式適用分	6,893	1,507	551	120
18	うち、内部モデル方式適用分	1,274,253	1,399,594	101,940	111,967
19	オペレーショナル・リスク	2,306,376	2,323,176	184,510	185,854
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	2,306,376	2,323,176	184,510	185,854
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	1,229,619	1,229,740	104,271	104,282
	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	1,828,325	1,752,812	146,266	140,225
25	合計（スケールリングファクター適用後）	53,425,611	52,248,875	4,274,048	4,179,910