

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際株式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	37,359,199	37,709,754	3,153,580	3,182,787
2	うち、標準的手法適用分	926,815	953,810	74,145	76,304
3	うち、内部格付手法適用分	34,342,519	34,584,832	2,912,245	2,932,793
	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	41,306	37,652	3,304	3,012
	その他	2,048,558	2,133,459	163,884	170,676
4	カウンターパーティ信用リスク	4,270,946	4,287,226	348,365	349,631
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	1,186,217	1,190,893	100,523	100,909
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,765,815	2,735,639	221,265	218,851
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	93,687	139,714	7,494	11,177
	その他	225,226	220,978	19,081	18,694
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	570,996	689,686	48,420	58,485
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）	1,634,096	1,649,732	130,727	131,978
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（マンドート方式）	—	—	—	—
	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%）	2,640	2,662	223	225
	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%）	364,092	302,715	30,875	25,670
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%）	15,459	16,461	1,236	1,316
11	未決済取引	2	1	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	1,166,276	1,153,444	93,302	92,275
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	964,192	1,004,311	77,135	80,344
14	うち、外部格付準拠方式適用分	185,506	134,547	14,840	10,763
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	16,577	14,585	1,326	1,166
16	マーケット・リスク	1,694,091	1,681,737	135,527	134,538
17	うち、標準的方式適用分	154,685	141,302	12,374	11,304
18	うち、内部モデル方式適用分	1,539,405	1,540,434	123,152	123,234
19	オペレーショナル・リスク	3,093,138	3,158,925	247,451	252,714
20	うち、基礎的手法適用分	622,561	607,569	49,804	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	2,470,576	2,551,356	197,646	204,108
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	1,382,498	1,373,863	117,206	116,503
	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	3,050,686	2,995,592	244,054	239,647
25	合計（スケールリングファクター適用後）	56,887,136	57,322,204	4,550,970	4,585,776