

OV1：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	37,214,044	37,212,984	3,149,898	3,149,739
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	35,994,769	35,979,330	3,052,356	3,051,047
	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	1,219,275	1,233,653	97,542	98,692
4	カウンターパーティ信用リスク	3,555,243	3,482,911	289,763	283,925
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	852,043	842,642	72,253	71,456
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,373,992	2,275,729	189,919	182,058
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	67,895	104,505	5,431	8,360
	その他	261,311	260,033	22,159	22,050
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	558,740	676,927	47,381	57,403
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）	1,614,780	1,639,208	129,182	131,136
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%）	450	444	38	37
	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%）	355,385	293,278	30,136	24,870
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	1,127,148	1,116,481	90,171	89,318
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	951,891	995,840	76,151	79,667
14	うち、外部格付準拠方式適用分	175,256	120,640	14,020	9,651
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	1,337,765	1,281,146	107,021	102,491
17	うち、標準的方式適用分	2,086	6,893	166	551
18	うち、内部モデル方式適用分	1,335,678	1,274,253	106,854	101,940
19	オペレーショナル・リスク	2,251,150	2,306,376	180,092	184,510
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	2,251,150	2,306,376	180,092	184,510
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	1,229,429	1,229,619	104,255	104,271
	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	1,971,544	1,828,325	157,723	146,266
25	合計（スケールリングファクター適用後）	53,570,810	53,425,611	4,285,664	4,274,048