

OV1：リスク・アセットの概要					
国際株式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	38,765,342	37,359,199	3,272,682	3,153,580
2	うち、標準的手法適用分	921,643	926,815	73,731	74,145
3	うち、内部格付手法適用分	35,719,844	34,342,519	3,029,042	2,912,245
	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	38,343	41,306	3,067	3,304
	その他	2,085,511	2,048,558	166,840	163,884
4	カウンターパーティ信用リスク	4,284,556	4,270,946	349,599	348,365
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	1,187,569	1,186,217	100,647	100,523
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,754,557	2,765,815	220,364	221,265
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	90,681	93,687	7,254	7,494
	その他	251,748	225,226	21,332	19,081
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	833,097	570,996	70,646	48,420
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）	1,788,641	1,634,096	143,091	130,727
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（マンドレート方式）	—	—	—	—
	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%）	2,629	2,640	222	223
	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%）	395,199	364,092	33,487	30,875
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%）	25,963	15,459	2,077	1,236
11	未決済取引	95	2	8	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	1,088,345	1,166,276	87,067	93,302
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	929,402	964,192	74,352	77,135
14	うち、外部格付準拠方式適用分	141,736	185,506	11,338	14,840
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	17,205	16,577	1,376	1,326
16	マーケット・リスク	1,657,828	1,694,091	132,626	135,527
17	うち、標準的方式適用分	107,108	154,685	8,568	12,374
18	うち、内部モデル方式適用分	1,550,720	1,539,405	124,057	123,152
19	オペレーショナル・リスク	3,054,275	3,093,138	244,342	247,451
20	うち、基礎的手法適用分	622,561	622,561	49,804	49,804
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	2,431,714	2,470,576	194,537	197,646
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	1,304,694	1,382,498	110,596	117,206
	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	3,181,811	3,050,686	254,544	244,054
25	合計（スケールリングファクター適用後）	58,762,415	56,887,136	4,700,993	4,550,970