

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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	42,419,518	40,936,349	3,568,915	3,442,320
2	うち、標準的手法適用分	2,803,902	3,050,149	224,312	244,011
3	うち、内部格付手法適用分	36,532,022	34,877,672	3,097,915	2,957,626
	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	49,277	46,881	3,942	3,750
	その他	3,034,316	2,961,646	242,745	236,931
4	カウンターパーティ信用リスク	5,092,524	5,382,967	413,965	437,131
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	1,395,199	1,495,568	117,167	125,330
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,968,643	3,067,315	237,491	245,385
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	170,146	213,245	13,611	17,059
	その他	558,534	606,838	45,694	49,356
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	756,101	789,942	64,117	66,987
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）	1,665,816	1,766,889	133,265	141,351
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（マデット方式）	—	—	—	—
	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%）	45,322	41,242	3,638	3,310
	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%）	334,996	375,427	28,269	31,730
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%）	38,188	59,012	3,055	4,720
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	2,263,787	2,509,994	181,102	200,799
17	うち、標準的方式適用分	723,352	825,580	57,868	66,046
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	3,880,470	3,924,796	310,437	313,983
20	うち、基礎的手法適用分	839,490	839,490	67,159	67,159
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	3,040,979	3,085,305	243,278	246,824
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	2,232,214	2,279,392	189,282	193,271
	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	139,336	—	11,146	—
25	合計（スケーリングファクター適用後）	62,493,410	61,599,066	4,999,472	4,927,925