

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	42,068,648	42,419,518	3,539,833	3,568,915				
2	うち、標準的手法適用分	2,744,761	2,803,902	219,580	224,312				
3	うち、内部格付手法適用分	36,321,266	36,532,022	3,080,043	3,097,915				
	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	53,004	49,277	4,240	3,942				
	その他	2,949,616	3,034,316	235,969	242,745				
4	カウンターパーティ信用リスク	5,177,589	5,092,524	420,797	413,965				
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	1,383,633	1,395,199	116,228	117,167				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	2,988,265	2,968,643	239,061	237,491				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	122,679	170,146	9,814	13,611				
	その他	683,011	558,534	55,693	45,694				
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	657,215	756,101	55,731	64,117				
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）	1,651,663	1,665,816	132,133	133,265				
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%）	36,419	45,322	2,926	3,638				
	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%）	411,569	334,996	34,693	28,269				
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%）	64,888	38,188	5,191	3,055				
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	2,441,428	2,263,787	195,314	181,102				
17	うち、標準的方式適用分	902,023	723,352	72,161	57,868				
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	3,804,177	3,880,470	304,334	310,437				
20	うち、基礎的手法適用分	863,199	839,490	69,055	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	2,940,978	3,040,979	235,278	243,278				
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	2,256,233	2,232,214	191,286	189,282				
	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	184,855	139,336	14,788	11,146				
25	合計（スケーリングファクター適用後）	62,379,156	62,493,410	4,990,332	4,999,472				