

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		リスク・アセット		所要自己資本		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	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	43,866,350	42,068,648	3,690,801	3,539,833				
2	うち、標準的手法適用分	2,758,016	2,744,761	220,641	219,580				
3	うち、内部格付手法適用分	37,811,087	36,321,266	3,206,380	3,080,043				
	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	50,138	53,004	4,011	4,240				
	その他	3,247,109	2,949,616	259,768	235,969				
4	カウンターパーティ信用リスク	5,087,487	5,177,589	413,750	420,797				
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	1,374,067	1,383,633	115,484	116,228				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	2,977,943	2,988,265	238,235	239,061				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	117,673	122,679	9,413	9,814				
	その他	617,803	683,011	50,616	55,693				
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	943,254	657,215	79,987	55,731				
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）	1,803,804	1,651,663	144,304	132,133				
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%）	34,854	36,419	2,800	2,926				
	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%）	444,727	411,569	37,468	34,693				
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%）	82,488	64,888	6,599	5,191				
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	2,650,901	2,441,428	212,072	195,314				
17	うち、標準的方式適用分	1,100,180	902,023	88,014	72,161				
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	3,816,213	3,804,177	305,297	304,334				
20	うち、基礎的手法適用分	863,199	863,199	69,055	69,055				
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	2,953,013	2,940,978	236,241	235,278				
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	2,204,656	2,256,233	186,899	191,286				
	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	183,267	184,855	14,661	14,788				
25	合計（スケーリングファクター適用後）	64,771,494	62,379,156	5,181,719	4,990,332				