

0V1：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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	39,360,837	38,955,356	3,332,225	3,297,806
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	38,199,770	37,786,994	3,239,340	3,204,337
	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	1,161,066	1,168,362	92,885	93,468
4	カウンターパーティ信用リスク	3,390,255	3,148,916	277,199	257,125
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	819,157	787,310	69,464	66,763
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,081,534	1,991,667	166,522	159,333
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	63,106	71,443	5,048	5,715
	その他	426,456	298,495	36,163	25,312
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	1,562,999	954,185	132,542	80,914
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）	2,208,413	1,851,352	176,673	148,108
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%）	40,284	40,298	3,416	3,417
	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%）	324,479	287,764	27,515	24,402
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%）	9,165	8,587	733	687
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	1,054,098	1,198,219	84,327	95,857
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	898,021	1,028,090	71,841	82,247
14	うち、外部格付準拠方式適用分	156,077	170,128	12,486	13,610
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	1,374,718	1,338,962	109,977	107,116
17	うち、標準的方式適用分	14,080	5,426	1,126	434
18	うち、内部モデル方式適用分	1,360,637	1,333,535	108,851	106,682
19	オペレーショナル・リスク	2,389,434	2,439,844	191,154	195,187
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	2,389,434	2,439,844	191,154	195,187
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	1,092,929	1,191,751	92,680	101,060
	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	3,218,655	2,987,416	257,492	238,993
25	合計（スケールリングファクター適用後）	58,574,236	56,883,463	4,685,938	4,550,677