

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	
		2018年3月末	2017年3月末	2018年3月末	2017年3月末
1	信用リスク	35,234,421		2,973,969	
2	うち、標準的手法適用分	540,754		43,260	
3	うち、内部格付手法適用分	32,336,654		2,742,148	
	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	48,595		3,887	
	その他	2,308,416		184,673	
4	カウンターパーティ信用リスク	3,146,011		256,415	
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	864,910		73,302	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、CVAリスク	1,923,397		153,871	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	113,497		9,079	
	その他	244,204		20,160	
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	980,607		83,155	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	15,642		1,251	
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	3,025,724		256,581	
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	813,330		68,930	
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	47,692		4,044	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	184,229		15,622	
15	うち、標準的手法適用分	8,350		668	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	573,058		48,595	
16	マーケット・リスク	1,886,551		150,924	
17	うち、標準的方式適用分	324,238		25,939	
18	うち、内部モデル方式適用分	1,562,313		124,985	
19	オペレーショナル・リスク	2,471,723		197,737	
20	うち、基礎的手法適用分	342,490		27,399	
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	2,129,233		170,338	
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	1,495,501		126,815	
	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	260,227		20,818	
25	合計（スケーリングファクター適用後）	51,707,483		4,136,598	