

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6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	36,036,620	35,234,421	3,042,438	2,973,969
2	うち、標準的手法適用分	504,124	540,754	40,329	43,260
3	うち、内部格付手法適用分	33,230,925	32,336,654	2,817,982	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	43,480	48,595	3,478	3,887
	その他	2,258,089	2,308,416	180,647	184,673
4	カウンターパーティ信用リスク	3,085,935	3,146,011	251,620	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	836,366	864,910	70,853	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	1,860,291	1,923,397	148,823	153,871
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	115,821	113,497	9,265	9,079
	その他	273,456	244,204	22,678	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	740,604	980,607	62,803	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	14,471	15,642	1,157	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	2,820,283	3,025,724	239,160	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	762,881	813,330	64,681	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	45,207	47,692	3,833	4,044
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	184,679	184,229	15,660	15,622
15	うち、標準的手法適用分	2,100	8,350	168	668
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	530,894	573,058	45,018	48,595
16	マーケット・リスク	2,017,132	1,886,551	161,370	150,924
17	うち、標準的方式適用分	304,937	324,238	24,394	25,939
18	うち、内部モデル方式適用分	1,712,194	1,562,313	136,975	124,985
19	オペレーショナル・リスク	2,464,546	2,471,723	197,163	197,737
20	うち、基礎的手法適用分	342,490	342,490	27,399	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	2,122,056	2,129,233	169,764	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	1,512,445	1,495,501	128,252	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	551,231	260,227	44,098	20,818
25	合計（スケーリングファクター適用後）	52,409,324	51,707,483	4,192,745	4,136,598