

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	34,565,808		2,925,200	
2	うち、標準的手法適用分	—		—	
3	うち、内部格付手法適用分	33,319,910		2,825,528	
	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	1,245,897		99,671	
4	カウンターパーティ信用リスク	2,570,854		209,300	
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	602,685		51,107	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、CVAリスク	1,736,363		138,909	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	77,861		6,228	
	その他	153,943		13,054	
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	976,543		82,810	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	—		—	
	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	3,039,984		257,790	
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	797,682		67,643	
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	43,035		3,649	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	181,588		15,398	
15	うち、標準的手法適用分	—		—	
	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	1,258,172		100,653	
17	うち、標準的方式適用分	1,433		114	
18	うち、内部モデル方式適用分	1,256,739		100,539	
19	オペレーショナル・リスク	1,941,968		155,357	
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	1,941,968		155,357	
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	1,431,505		121,391	
	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	—		—	
25	合計（スケーリングファクター適用後）	49,001,855		3,920,148	