

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	44,008,267		3,691,956	
2	うち、標準的手法適用分	4,773,898		381,911	
3	うち、内部格付手法適用分	35,686,496		3,026,214	
	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	467,926		37,434	
	その他	3,079,946		246,395	
4	カウンターパーティ信用リスク	3,918,579		318,144	
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	1,051,112		88,124	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、CVAリスク	2,252,318		180,185	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	172,536		13,802	
	その他	442,610		36,031	
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	1,134,141		96,175	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	140,870		11,269	
	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	3,125,588		265,049	
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	817,315		69,249	
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	12,334		986	
	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	2,697,316		215,785	
17	うち、標準的方式適用分	1,135,003		90,800	
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	3,549,141		283,931	
20	うち、基礎的手法適用分	700,718		56,057	
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	2,848,423		227,873	
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	1,552,824		131,661	
	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）	63,540,277		5,083,222	