

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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	35,358,960	35,361,185	2,981,815	2,984,433
2	うち、標準的手法適用分	1,003,479	534,525	80,278	42,762
3	うち、内部格付手法適用分	31,895,518	32,403,917	2,704,739	2,747,852
	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	42,550	42,910	3,404	3,432
	その他	2,417,411	2,379,831	193,392	190,386
4	カウンターパーティ信用リスク	3,195,222	3,045,340	260,404	248,549
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	871,587	861,823	73,837	73,004
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,025,539	1,872,627	162,043	149,810
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	148,500	128,145	11,880	10,251
	その他	149,595	182,743	12,643	15,482
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	632,222	897,807	53,612	76,134
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）	2,095,088	—	167,607	—
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%）	4,806	—	407	—
	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%）	297,526	—	25,230	—
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%）	15,125	—	1,210	—
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	—	15,230	—	1,218
	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	—	2,605,082	—	220,911
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	1,136,269	724,572	90,901	61,377
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	970,149	—	77,611	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	158,514	—	12,681	—
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	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	—	80,626	—	6,837
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	182,726	—	15,495
	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	7,605	461,220	608	39,045
16	マーケット・リスク	1,714,611	1,864,042	137,168	149,123
17	うち、標準的方式適用分	143,515	346,348	11,481	27,707
18	うち、内部モデル方式適用分	1,571,096	1,517,693	125,687	121,415
19	オペレーショナル・リスク	2,840,693	2,638,121	227,255	211,049
20	うち、基礎的手法適用分	561,790	380,239	44,943	30,419
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	2,278,902	2,257,881	182,312	180,630
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	1,418,413	1,580,053	120,281	133,988
	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	2,087,000	1,303,488	166,960	104,279
25	合計（スケールリングファクター適用後）	52,910,688	52,388,304	4,232,855	4,191,064