

0V1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		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	34,232,760	34,499,493	2,897,120	2,919,458
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	33,020,697	33,228,883	2,800,155	2,817,809
	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	1,212,062	1,270,610	96,965	101,648
4	カウンターパーティ信用リスク	2,536,826	2,689,776	206,744	218,892
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	587,207	588,045	49,795	49,866
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,645,484	1,834,253	131,638	146,740
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	100,015	82,561	8,001	6,604
	その他	204,117	184,915	17,309	15,680
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	844,840	895,874	71,642	75,970
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）	2,085,768	—	166,861	—
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（マナド方式）	—	—	—	—
	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%）	632	—	53	—
	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%）	297,517	—	25,229	—
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%）	—	—	—	—
	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	—	2,637,859	—	223,690
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	1,112,245	705,420	88,979	59,819
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	960,799	—	76,863	—
14	うち、外部格付準拠方式適用分	151,446	—	12,115	—
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	—	77,394	—	6,563
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	180,645	—	15,318
	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	447,380	—	37,937
16	マーケット・リスク	1,234,863	1,174,463	98,789	93,957
17	うち、標準的方式適用分	2,831	4,080	226	326
18	うち、内部モデル方式適用分	1,232,032	1,170,382	98,562	93,630
19	オペレーショナル・リスク	2,060,777	2,065,215	164,862	165,217
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	2,060,777	2,065,215	164,862	165,217
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	1,290,164	1,428,290	109,405	121,119
	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	1,703,411	890,284	136,272	71,222
25	合計（スケールリングファクター適用後）	49,574,518	49,366,836	3,965,961	3,949,346