

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9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	35,335,405	36,036,620	2,982,839	3,042,438
2	うち、標準的手法適用分	518,153	504,124	41,452	40,329
3	うち、内部格付手法適用分	32,501,421	33,230,925	2,756,120	2,817,982
	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	42,460	43,480	3,396	3,478
	その他	2,273,370	2,258,089	181,869	180,647
4	カウンターパーティ信用リスク	2,893,748	3,085,935	236,153	251,620
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	813,368	836,366	68,897	70,853
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,794,035	1,860,291	143,522	148,823
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	112,996	115,821	9,039	9,265
	その他	173,348	273,456	14,693	22,678
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	842,001	740,604	71,401	62,803
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	14,927	14,471	1,194	1,157
	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	2,775,201	2,820,283	235,337	239,160
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	767,424	762,881	65,055	64,681
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	67,565	45,207	5,729	3,833
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	188,404	184,679	15,976	15,660
15	うち、標準的手法適用分	2,100	2,100	168	168
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	509,354	530,894	43,181	45,018
16	マーケット・リスク	1,783,947	2,017,132	142,715	161,370
17	うち、標準的方式適用分	286,775	304,937	22,942	24,394
18	うち、内部モデル方式適用分	1,497,172	1,712,194	119,773	136,975
19	オペレーショナル・リスク	2,643,652	2,464,546	211,492	197,163
20	うち、基礎的手法適用分	380,239	342,490	30,419	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	2,263,412	2,122,056	181,073	169,764
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	1,540,442	1,512,445	130,626	128,252
	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	1,599,865	551,231	127,989	44,098
25	合計（スケーリングファクター適用後）	52,560,056	52,409,324	4,204,804	4,192,745