

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	34,671,736	35,315,408	2,934,407	2,988,886
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	33,472,648	34,094,629	2,838,480	2,891,224
	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	1,199,088	1,220,779	95,927	97,662
4	カウンターパーティ信用リスク	2,542,724	2,655,094	207,008	216,320
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	564,349	588,179	47,856	49,877
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	1,716,007	1,756,582	137,280	140,526
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	78,598	83,323	6,287	6,665
	その他	183,768	227,008	15,583	19,250
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	839,243	739,460	71,167	62,706
	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	2,804,084	2,841,646	237,786	240,971
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	756,923	754,753	64,187	64,003
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	64,159	41,912	5,440	3,554
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	185,929	182,177	15,766	15,448
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	506,835	530,663	42,979	45,000
16	マーケット・リスク	1,190,463	1,353,235	95,237	108,258
17	うち、標準的方式適用分	6,650	7,723	532	617
18	うち、内部モデル方式適用分	1,183,812	1,345,511	94,704	107,640
19	オペレーショナル・リスク	2,070,889	1,938,759	165,671	155,100
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	2,070,889	1,938,759	165,671	155,100
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	1,405,384	1,432,942	119,176	121,513
	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	1,204,354	209,760	96,348	16,780
25	合計（スケーリングファクター適用後）	49,887,388	49,681,779	3,990,991	3,974,542