

| OV1：リスク・アセットの概要 |                                    |            |            |           |           |
|-----------------|------------------------------------|------------|------------|-----------|-----------|
| 国際様式の<br>該当番号   |                                    | イ          | ロ          | ハ         | ニ         |
|                 |                                    | リスク・アセット   |            | 所要自己資本    |           |
|                 |                                    | 2018年12月末  | 2018年9月末   | 2018年12月末 | 2018年9月末  |
| 1               | 信用リスク                              | 34,499,493 | 34,671,736 | 2,919,458 | 2,934,407 |
| 2               | うち、標準的手法適用分                        | —          | —          | —         | —         |
| 3               | うち、内部格付手法適用分                       | 33,228,883 | 33,472,648 | 2,817,809 | 2,838,480 |
|                 | 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                                | 1,270,610  | 1,199,088  | 101,648   | 95,927    |
| 4               | カウンターパーティ信用リスク                     | 2,689,776  | 2,542,724  | 218,892   | 207,008   |
| 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              | 588,045    | 564,349    | 49,866    | 47,856    |
| 6               | うち、期待エクスポージャー方式適用分                 | —          | —          | —         | —         |
|                 | うち、CVAリスク                          | 1,834,253  | 1,716,007  | 146,740   | 137,280   |
|                 | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                | 82,561     | 78,598     | 6,604     | 6,287     |
|                 | その他                                | 184,915    | 183,768    | 15,680    | 15,583    |
| 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         | 895,874    | 839,243    | 75,970    | 71,167    |
|                 | 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  | 2,804,084  | 223,690   | 237,786   |
| 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 | 705,420    | 756,923    | 59,819    | 64,187    |
| 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   | 77,394     | 64,159     | 6,563     | 5,440     |
| 14              | うち、内部格付手法における指定関数方式適用分             | 180,645    | 185,929    | 15,318    | 15,766    |
| 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               | 447,380    | 506,835    | 37,937    | 42,979    |
| 16              | マーケット・リスク                          | 1,174,463  | 1,190,463  | 93,957    | 95,237    |
| 17              | うち、標準的方式適用分                        | 4,080      | 6,650      | 326       | 532       |
| 18              | うち、内部モデル方式適用分                      | 1,170,382  | 1,183,812  | 93,630    | 94,704    |
| 19              | オペレーショナル・リスク                       | 2,065,215  | 2,070,889  | 165,217   | 165,671   |
| 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                      | 2,065,215  | 2,070,889  | 165,217   | 165,671   |
| 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   | 1,428,290  | 1,405,384  | 121,119   | 119,176   |
|                 | 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                              | 890,284    | 1,204,354  | 71,222    | 96,348    |
| 25              | 合計（スケーリングファクター適用後）                 | 49,366,836 | 49,887,388 | 3,949,346 | 3,990,991 |