

OV1：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	39,966,325	39,913,097	3,360,021	3,357,926
2	うち、標準的手法適用分	2,843,844	2,203,420	227,507	176,273
3	うち、内部格付手法適用分	33,898,986	34,349,789	2,874,634	2,912,862
	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	52,206	51,960	4,176	4,156
	その他	3,171,288	3,307,926	253,703	264,634
4	カウンターパーティ信用リスク	4,111,505	4,298,838	333,623	348,743
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	1,094,827	1,098,598	91,618	91,862
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,376,345	2,221,934	190,107	177,754
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	177,913	161,436	14,233	12,914
	その他	462,418	816,869	37,664	66,211
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	699,163	960,811	59,289	81,476
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）	2,107,834	—	168,626	—
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%）	20,577	—	1,669	—
	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%）	317,353	—	26,834	—
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%）	41,684	—	3,334	—
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	—	113,009	—	9,040
	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	—	2,651,691	—	224,863
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	2,323,156	2,606,221	185,852	208,497
17	うち、標準的方式適用分	752,059	1,088,527	60,164	87,082
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	3,617,535	3,653,913	289,402	292,313
20	うち、基礎的手法適用分	776,185	768,240	62,094	61,459
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	2,841,349	2,885,673	227,307	230,853
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	2,309,872	2,378,168	195,867	201,664
	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	—	—	—	—
25	合計（スケールリングファクター適用後）	58,942,791	59,823,795	4,715,423	4,785,903