

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6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	45,025,200	44,008,267	3,777,479	3,691,956
2	うち、標準的手法適用分	4,891,128	4,773,898	391,290	381,911
3	うち、内部格付手法適用分	36,554,794	35,686,496	3,099,846	3,026,214
	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	483,396	467,926	38,671	37,434
	その他	3,095,880	3,079,946	247,670	246,395
4	カウンターパーティ信用リスク	3,890,464	3,918,579	315,919	318,144
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	1,035,764	1,051,112	86,743	88,124
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,208,285	2,252,318	176,662	180,185
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	141,802	172,536	11,344	13,802
	その他	504,612	442,610	41,169	36,031
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	904,040	1,134,141	76,662	96,175
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	115,967	140,870	9,277	11,269
	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	2,913,412	3,125,588	247,057	265,049
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	767,023	817,315	65,012	69,249
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	45,207	47,692	3,833	4,044
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	184,679	184,229	15,660	15,622
15	うち、標準的手法適用分	6,241	12,334	499	986
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	530,894	573,058	45,018	48,595
16	マーケット・リスク	2,743,484	2,697,316	219,478	215,785
17	うち、標準的方式適用分	1,031,289	1,135,003	82,503	90,800
18	うち、内部モデル方式適用分	1,712,194	1,562,313	136,975	124,985
19	オペレーショナル・リスク	3,498,697	3,549,141	279,895	283,931
20	うち、基礎的手法適用分	700,718	700,718	56,057	56,057
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	2,797,978	2,848,423	223,838	227,873
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	1,544,813	1,552,824	130,994	131,661
	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（スケーリングファクター適用後）	64,022,210	63,540,277	5,121,776	5,083,222