

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	44,447,205	45,025,200	3,727,707	3,777,479
2	うち、標準的手法適用分	4,951,532	4,891,128	396,122	391,290
3	うち、内部格付手法適用分	35,818,920	36,554,794	3,037,444	3,099,846
	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	496,077	483,396	39,686	38,671
	その他	3,180,674	3,095,880	254,453	247,670
4	カウンターパーティ信用リスク	4,040,387	3,890,464	327,816	315,919
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	1,021,873	1,035,764	85,511	86,743
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,172,862	2,208,285	173,829	176,662
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	140,233	141,802	11,218	11,344
	その他	705,418	504,612	57,257	41,169
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	1,020,903	904,040	86,572	76,662
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	150,532	115,967	12,042	9,277
	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	2,866,824	2,913,412	243,106	247,057
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	771,683	767,023	65,396	65,012
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	6,359	6,241	508	499
	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	2,479,594	2,743,484	198,367	219,478
17	うち、標準的方式適用分	982,422	1,031,289	78,593	82,503
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	3,691,362	3,498,697	295,309	279,895
20	うち、基礎的手法適用分	768,240	700,718	61,459	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	2,923,122	2,797,978	233,849	223,838
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	1,581,452	1,544,813	134,098	130,994
	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）	63,630,215	64,022,210	5,090,417	5,121,776