

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12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	39,913,097	44,447,205	3,357,926	3,727,707
2	うち、標準的手法適用分	2,203,420	4,951,532	176,273	396,122
3	うち、内部格付手法適用分	34,349,789	35,818,920	2,912,862	3,037,444
	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	51,960	496,077	4,156	39,686
	その他	3,307,926	3,180,674	264,634	254,453
4	カウンターパーティ信用リスク	4,298,838	4,040,387	348,743	327,816
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	1,098,598	1,021,873	91,862	85,511
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,221,934	2,172,862	177,754	173,829
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	161,436	140,233	12,914	11,218
	その他	816,869	705,418	66,211	57,257
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	960,811	1,020,903	81,476	86,572
	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	150,532	9,040	12,042
	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	2,866,824	224,863	243,106
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	724,572	771,683	61,377	65,396
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	80,626	67,565	6,837	5,729
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	182,726	188,404	15,495	15,976
15	うち、標準的手法適用分	—	6,359	—	508
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	461,220	509,354	39,045	43,181
16	マーケット・リスク	2,606,221	2,479,594	208,497	198,367
17	うち、標準的方式適用分	1,088,527	982,422	87,082	78,593
18	うち、内部モデル方式適用分	1,517,693	1,497,172	121,415	119,773
19	オペレーショナル・リスク	3,653,913	3,691,362	292,313	295,309
20	うち、基礎的手法適用分	768,240	768,240	61,459	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	2,885,673	2,923,122	230,853	233,849
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	2,378,168	1,581,452	201,664	134,098
	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）	59,823,795	63,630,215	4,785,903	5,090,417