

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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	35,723,440	35,358,960	3,012,458	2,981,815
2	うち、標準的手法適用分	1,004,639	1,003,479	80,371	80,278
3	うち、内部格付手法適用分	32,204,859	31,895,518	2,730,972	2,704,739
	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	42,688	42,550	3,415	3,404
	その他	2,471,252	2,417,411	197,700	193,392
4	カウンターパーティ信用リスク	3,485,517	3,195,222	284,050	260,404
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	965,932	871,587	81,840	73,837
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	2,219,793	2,025,539	177,583	162,043
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	139,585	148,500	11,166	11,880
	その他	160,205	149,595	13,459	12,643
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	700,629	632,222	59,413	53,612
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）	2,302,352	2,095,088	184,188	167,607
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%）	4,787	4,806	405	407
	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%）	311,715	297,526	26,433	25,230
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%）	15,311	15,125	1,224	1,210
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	1,131,645	1,136,269	90,531	90,901
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	970,815	970,149	77,665	77,611
14	うち、外部格付準拠方式適用分	152,270	158,514	12,181	12,681
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	8,559	7,605	684	608
16	マーケット・リスク	1,773,955	1,714,611	141,916	137,168
17	うち、標準的方式適用分	162,884	143,515	13,030	11,481
18	うち、内部モデル方式適用分	1,611,070	1,571,096	128,885	125,687
19	オペレーショナル・リスク	2,839,406	2,840,693	227,152	227,255
20	うち、基礎的手法適用分	561,790	561,790	44,943	44,943
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	2,277,615	2,278,902	182,209	182,312
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	1,430,200	1,418,413	121,280	120,281
	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	1,777,877	2,087,000	142,230	166,960
25	合計（スケーリングファクター適用後）	53,641,083	52,910,688	4,291,286	4,232,855