

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(単体) |                                    |                     |                     |                     |                     |
|---------------------|------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 国際様式の<br>該当番号       |                                    | イ                   | ロ                   | ハ                   | ニ                   |
|                     |                                    | リスク・アセット            |                     | 所要自己資本              |                     |
|                     |                                    | 当中間期末<br>(2018年9月末) | 前中間期末<br>(2017年9月末) | 当中間期末<br>(2018年9月末) | 前中間期末<br>(2017年9月末) |
| 1                   | 信用リスク                              | 7,051,922           |                     | 564,153             |                     |
| 2                   | うち、標準的手法適用分                        | 7,003,762           |                     | 560,301             |                     |
| 3                   | うち、内部格付手法適用分                       | -                   |                     | -                   |                     |
|                     | 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        | -                   |                     | -                   |                     |
|                     | その他                                | 48,159              |                     | 3,852               |                     |
| 4                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 108,797             |                     | 8,703               |                     |
| 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              | 69,328              |                     | 5,546               |                     |
| 6                   | うち、期待エクスポージャー方式適用分                 | -                   |                     | -                   |                     |
|                     | うち、CVAリスク                          | 39,112              |                     | 3,128               |                     |
|                     | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                | 348                 |                     | 27                  |                     |
|                     | その他                                | 9                   |                     | 0                   |                     |
| 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         | -                   |                     | -                   |                     |
|                     | 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー           | -                   |                     | -                   |                     |
|                     | 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     | -                   |                     | -                   |                     |
| 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 | 4,421               |                     | 353                 |                     |
| 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   | -                   |                     | -                   |                     |
| 14                  | うち、内部格付手法における指定関数方式適用分             | -                   |                     | -                   |                     |
| 15                  | うち、標準的手法適用分                        | 4,421               |                     | 353                 |                     |
|                     | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分               | -                   |                     | -                   |                     |
| 16                  | マーケット・リスク                          | -                   |                     | -                   |                     |
| 17                  | うち、標準的方式適用分                        | -                   |                     | -                   |                     |
| 18                  | うち、内部モデル方式適用分                      | -                   |                     | -                   |                     |
| 19                  | オペレーショナル・リスク                       | 235,199             |                     | 18,815              |                     |
| 20                  | うち、基礎的手法適用分                        | 235,199             |                     | 18,815              |                     |
| 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                      | -                   |                     | -                   |                     |
| 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   | 109,685             |                     | 8,774               |                     |
|                     | 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                                 | 7,510,027           |                     | 600,802             |                     |

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要(単体) |                                    |                     |                     |                     |                     |
|---------------------|------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 国際様式の<br>該当番号       |                                    | イ                   | ロ                   | ハ                   | ニ                   |
|                     |                                    | リスク・アセット            |                     | 所要自己資本              |                     |
|                     |                                    | 当四半期末<br>(2018年9月末) | 前四半期末<br>(2018年6月末) | 当四半期末<br>(2018年9月末) | 前四半期末<br>(2018年6月末) |
| 1                   | 信用リスク                              | 7,051,922           | 6,978,082           | 564,153             | 558,246             |
| 2                   | うち、標準的手法適用分                        | 7,003,762           | 6,929,404           | 560,301             | 554,352             |
| 3                   | うち、内部格付手法適用分                       | -                   | -                   | -                   | -                   |
|                     | 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        | -                   | -                   | -                   | -                   |
|                     | その他                                | 48,159              | 48,678              | 3,852               | 3,894               |
| 4                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 108,797             | 108,257             | 8,703               | 8,660               |
| 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              | 69,328              | 68,866              | 5,546               | 5,509               |
| 6                   | うち、期待エクスポージャー方式適用分                 | -                   | -                   | -                   | -                   |
|                     | うち、CVAリスク                          | 39,112              | 39,045              | 3,128               | 3,123               |
|                     | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                | 348                 | 345                 | 27                  | 27                  |
|                     | その他                                | 9                   | -                   | 0                   | -                   |
| 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         | -                   | -                   | -                   | -                   |
|                     | 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー           | -                   | -                   | -                   | -                   |
|                     | 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     | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 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 | 4,421               | 4,650               | 353                 | 372                 |
| 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   | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 14                  | うち、内部格付手法における指定関数方式適用分             | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 15                  | うち、標準的手法適用分                        | 4,421               | 4,650               | 353                 | 372                 |
|                     | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分               | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 16                  | マーケット・リスク                          | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 17                  | うち、標準的方式適用分                        | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 18                  | うち、内部モデル方式適用分                      | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 19                  | オペレーショナル・リスク                       | 235,199             | 245,688             | 18,815              | 19,655              |
| 20                  | うち、基礎的手法適用分                        | 235,199             | 245,688             | 18,815              | 19,655              |
| 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                      | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 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   | 109,685             | 112,175             | 8,774               | 8,974               |
|                     | 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                                 | 7,510,027           | 7,448,854           | 600,802             | 595,908             |