

## 連結リスク・アセットの概要(2018年6月末)

(別紙様式第八号) 第一面

(単位:百万円)

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	
		当四半期末	前四半期末	当四半期末	前四半期末
1	信用リスク	3,197,978	3,272,248	270,478	276,786
2	うち、標準的手法適用分	79,688	78,020	6,375	6,241
3	うち、内部格付手法適用分	3,050,096	3,126,386	258,648	265,117
	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	68,193	67,842	5,455	5,427
4	カウンターパーティ信用リスク	30,693	34,435	2,521	2,833
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	11,889	12,737	1,008	1,080
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,783	17,944	1,342	1,435
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	63	63	5	5
	その他	1,957	3,689	166	312
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	258,781	284,868	21,944	24,156
	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	216,141	216,079	18,328	18,323
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	22	25	1	2
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	22	25	1	2
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	-	-	-	-
	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	168,656	168,656	13,492	13,492
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	168,656	168,656	13,492	13,492
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	10,330	10,031	876	850
	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	3,882,605	3,986,346	327,644	336,446