

連結リスク・アセットの概要(2018年9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	3,209,342	3,197,978	271,423	270,478
2	うち、標準的手法適用分	82,930	79,688	6,634	6,375
3	うち、内部格付手法適用分	3,057,494	3,050,096	259,275	258,648
	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	68,917	68,193	5,513	5,455
4	カウンターパーティ信用リスク	31,527	30,693	2,591	2,521
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	12,492	11,889	1,059	1,008
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,102	16,783	1,368	1,342
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	62	63	4	5
	その他	1,870	1,957	158	166
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	259,642	258,781	22,017	21,944
	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	260,970	216,141	22,130	18,328
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	20	22	1	1
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	20	22	1	1
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	168,889	168,656	13,511	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	168,889	168,656	13,511	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	10,591	10,330	898	876
	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	3,940,984	3,882,605	332,573	327,644