

単体リスク・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	3,162,729	3,154,957	267,824	267,168
2	うち、標準的手法適用分	12,261	12,336	980	986
3	うち、内部格付手法適用分	3,084,654	3,077,498	261,578	260,971
	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	65,813	65,121	5,265	5,209
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	256,950	255,841	21,789	21,695
	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	261,896	217,089	22,208	18,409
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	160,845	160,854	12,867	12,868
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	160,845	160,854	12,867	12,868
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	4,262	4,366	361	370
	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	3,878,233	3,823,825	327,645	323,035