

連結リスク・アセットの概要(2018年12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	3,201,437	3,209,342	270,730	271,423
2	うち、標準的手法適用分	87,507	82,930	7,000	6,634
3	うち、内部格付手法適用分	3,044,989	3,057,494	258,215	259,275
	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	68,941	68,917	5,515	5,513
4	カウンターパーティ信用リスク	31,528	31,527	2,589	2,591
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	12,633	12,492	1,071	1,059
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,438	17,102	1,395	1,368
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	61	62	4	4
	その他	1,394	1,870	118	158
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	249,928	259,642	21,193	22,017
	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	284,234	260,970	24,103	22,130
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	18	20	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	18	20	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	168,889	13,511	13,511
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	168,889	13,511	13,511
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	10,412	10,591	882	898
	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	3,946,449	3,940,984	333,013	332,573