

単体リスク・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	3,154,186	3,162,729	267,086	267,824
2	うち、標準的手法適用分	15,245	12,261	1,219	980
3	うち、内部格付手法適用分	3,073,153	3,084,654	260,603	261,578
	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	65,787	65,813	5,262	5,265
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	247,400	256,950	20,979	21,789
	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	285,161	261,896	24,181	22,208
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	160,845	160,845	12,867	12,867
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	160,845	12,867	12,867
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	4,324	4,262	366	361
	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	3,883,465	3,878,233	328,072	327,645