

単体リスク・アセットの概要
(2019年3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		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2019年3月末)	前四半期末 (2018年12月末)	当四半期末 (2019年3月末)	前四半期末 (2018年12月末)
1	信用リスク	3,225,868	3,154,186	273,177	267,086
2	うち、標準的手法適用分	12,753	15,245	1,020	1,219
3	うち、内部格付手法適用分	3,147,456	3,073,153	266,904	260,603
	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	65,658	65,787	5,252	5,262
4	カウンターパーティ信用リスク	32,269	31,528	2,657	2,589
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	14,016	12,633	1,188	1,071
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,382	17,438	1,310	1,395
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	62	61	4	4
	その他	1,808	1,394	153	118
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	264,818	247,400	22,456	20,979
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルックスルー方式)	323,794		27,457	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	28,092		2,382	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	-		-	
	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		24,181
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	34	18	2	1
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-		-	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	34		2	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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のうち、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		1
	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のうち、内部格付手法における指定関数方式適用分		-		-
	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のうち、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	157,303	160,845	12,584	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	157,303	160,845	12,584	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	4,072	4,324	345	366
	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	4,036,254	3,883,465	341,063	328,072