

連結リスク・アセットの概要  
(2019年6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6月末)	前四半期末 (2019年3月末)	当四半期末 (2019年6月末)	前四半期末 (2019年3月末)
1	信用リスク	3,188,086	3,271,577	269,606	276,689
2	うち、標準的手法適用分	86,289	85,391	6,903	6,831
3	うち、内部格付手法適用分	3,033,153	3,117,375	257,211	264,353
	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	68,642	68,810	5,491	5,504
4	カウンターパーティ信用リスク	30,222	32,269	2,486	2,657
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	12,897	14,016	1,093	1,188
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	15,863	16,382	1,269	1,310
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	62	62	4	4
	その他	1,400	1,808	118	153
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	242,571	267,379	20,570	22,673
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)	343,229	323,030	29,105	27,392
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nderト方式)	28,165	28,092	2,388	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%)	-	-	-	-
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	36	34	2	2
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	36	34	2	2
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	165,572	165,572	13,245	13,245
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	165,572	165,572	13,245	13,245
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	12,336	12,096	1,046	1,025
	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	4,010,221	4,100,052	338,451	346,070