

連結リスク・アセットの概要 (2019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 (2019年9月末)	前四半期末 (2019年6月末)	当四半期末 (2019年9月末)	前四半期末 (2019年6月末)
1	信用リスク	3,193,040	3,188,086	270,003	269,606
2	うち、標準的手法適用分	90,853	86,289	7,268	6,903
3	うち、内部格付手法適用分	3,033,371	3,033,153	257,229	257,211
	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	68,816	68,642	5,505	5,491
4	カウンターパーティ信用リスク	29,561	30,222	2,433	2,486
5	うち、S A - C C R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	12,779	12,897	1,083	1,093
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、C V Aリスク	15,280	15,863	1,222	1,269
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	62	1	4
	その他	1,478	1,400	125	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	273,703	242,571	23,210	20,570
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)	372,999	343,229	31,630	29,105
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 (マંデート方式)	27,207	28,165	2,307	2,388
	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	29	36	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	29	36	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	163,938	165,572	13,115	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	163,938	165,572	13,115	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	12,377	12,336	1,049	1,046
	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	4,072,858	4,010,221	343,751	338,451