

単体リスク・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		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	3,145,062	3,142,738	266,314	266,126
2	うち、標準的手法適用分	15,116	13,288	1,209	1,063
3	うち、内部格付手法適用分	3,064,531	3,064,125	259,872	259,837
	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	65,414	65,325	5,233	5,226
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、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	12,779	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、CVA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	270,203	239,600	22,913	20,318
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)	373,762	343,993	31,695	29,170
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)	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	155,246	157,303	12,419	12,584
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,246	157,303	12,419	12,584
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	3,971	4,011	336	340
	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	4,005,045	3,946,072	338,422	333,417