

単体リスク・アセットの概要
(2019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		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12月末)	前四半期末 (2019年9月末)	当四半期末 (2019年12月末)	前四半期末 (2019年9月末)
1	信用リスク	3,170,787	3,145,062	268,494	266,314
2	うち、標準的手法適用分	15,785	15,116	1,262	1,209
3	うち、内部格付手法適用分	3,089,810	3,064,531	262,015	259,872
	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	65,192	65,414	5,215	5,233
4	カウンターパーティ信用リスク	29,035	29,561	2,391	2,433
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	12,480	12,779	1,058	1,083
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	14,615	15,280	1,169	1,222
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	23	1	1
	その他	1,917	1,478	162	125
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	261,791	270,203	22,199	22,913
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)	308,886	373,762	26,193	31,695
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)	34,510	27,207	2,926	2,307
	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	26	29	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	26	29	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	155,246	12,419	12,419
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	155,246	12,419	12,419
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	3,910	3,971	331	336
	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	3,964,196	4,005,045	334,959	338,422