

連結リスク・アセットの概要(2018年3月末)

(別紙様式第八号) 別紙1-3 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	前四半期末	当四半期末	前四半期末
1	信用リスク	3,272,248		276,786	
2	うち、標準的手法適用分	78,020		6,241	
3	うち、内部格付手法適用分	3,126,386		265,117	
	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	67,842		5,427	
4	カウンターパーティ信用リスク	34,435		2,833	
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	12,737		1,080	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	17,944		1,435	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	63		5	
	その他	3,689		312	
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	284,868		24,156	
	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	216,079		18,323	
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	25		2	
13	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	25		2	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-		-	
15	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	168,656		13,492	
20	うち、基礎的手法適用分	-		-	
21	うち、粗利益配分手法適用分	168,656		13,492	
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	10,031		850	
	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	3,986,346		336,446	