

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018年6月末)

連結

(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	前四半期末	当四半期末	前四半期末
1	信用リスク	1,916,367	1,921,335	153,309	153,706
2	うち、標準的手法適用分	1,866,649	1,871,079	149,331	149,686
3	うち、内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	49,718	50,255	3,977	4,020
4	カウンターパーティ信用リスク	669	1,118	53	89
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	223	505	17	40
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	117	247	9	19
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16	8	1	0
	その他	312	356	24	28
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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	69,381	69,381	5,550	5,550
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	69,381	69,381	5,550	5,550
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	-	-	-	-
	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	1,986,418	1,991,835	158,913	159,346

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018年6月末)

単体

(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	前四半期末	当四半期末	前四半期末
1	信用リスク	1,877,301	1,882,835	150,184	150,626
2	うち、標準的手法適用分	1,839,372	1,828,405	147,149	146,272
3	うち、内部格付手法適用分	-	-	-	-
	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	37,929	54,429	3,034	4,354
4	カウンターパーティ信用リスク	669	1,118	53	89
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	223	505	40	40
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	117	247	9	19
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16	8	1	0
	その他	312	356	24	28
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	-	-	-	-
	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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	-	-	-	-
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	63,933	63,933	5,114	5,114
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	63,933	63,933	5,114	5,114
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	-	-	-	-
	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	1,941,904	1,947,886	155,352	155,830