

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018年12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	1,983,414	1,962,590	158,673	157,007
2	うち、標準的手法適用分	1,929,453	1,912,747	154,356	153,019
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	53,960	49,842	4,316	3,987
4	カウンターパーティ信用リスク	875	596	70	47
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	426	184	34	14
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	206	101	16	8
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	38	23	3	1
	その他	204	286	16	22
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	16,447	4,000	1,315	4,000
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	3,944	4,000	315	4,000
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	12,503	-	1,000	-
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	68,138	68,138	5,451	5,451
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	68,138	68,138	5,451	5,451
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	2,068,876	2,035,325	165,510	162,826

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018年12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	1,941,553	1,922,844	155,324	153,827
2	うち、標準的手法適用分	1,901,127	1,884,817	152,090	150,785
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	40,425	38,026	3,234	3,042
4	カウンターパーティ信用リスク	875	596	70	47
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	426	184	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	206	101	16	8
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	38	23	3	1
	その他	204	286	16	22
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	16,447	4,000	1,315	320
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	3,944	4,000	315	320
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	12,503	-	1,000	-
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	63,383	63,383	5,070	5,070
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	63,383	63,383	5,070	5,070
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	2,022,259	1,990,823	161,780	159,265