

## ■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<br>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<br>の該当番<br>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 |