

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2019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	1,965,524	1,988,513	157,241	159,081
2	うち、標準的手法適用分	1,914,188	1,938,168	153,135	155,053
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	51,335	50,344	4,106	4,027
4	カウンターパーティ信用リスク	916	687	73	54
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	538	327	43	26
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	221	128	17	10
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	156	231	12	18
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	-	-	-	-
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)	11,379	15,853	910	1,268
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(マンドート方式)	-	-	-	-
	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	4,014	4,050	321	324
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	3,863	3,900	309	312
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	150	150	12	12
	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	67,559	67,559	5,404	5,404
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	67,559	67,559	5,404	5,404
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	2,049,394	2,076,663	163,951	166,133

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2019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	1,924,670	1,946,312	153,973	155,705
2	うち、標準的手法適用分	1,885,973	1,908,619	150,877	152,689
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	38,697	37,693	3,095	3,015
4	カウンターパーティ信用リスク	916	687	73	54
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	538	327	43	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	221	128	17	10
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	156	231	12	18
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	-	-	-	-
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)	11,374	15,849	909	1,267
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(マンドート方式)	-	-	-	-
	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%方式)	-	-	-	-
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	4,014	4,050	321	324
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	3,863	3,900	309	312
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	150	150	12	12
	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	62,873	62,873	5,029	5,029
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	62,873	62,873	5,029	5,029
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	2,003,850	2,029,772	160,308	162,381