

■OV1:リスク・アセットの概要 (2019年9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	2,008,225	1,965,524	160,658	157,241
2	うち、標準的手法適用分	1,957,628	1,914,188	156,610	153,135
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	50,596	51,335	4,047	4,106
4	カウンターパーティ信用リスク	642	916	51	73
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	422	538	33	43
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	134	221	10	17
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	85	156	6	12
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)	14,335	11,379	1,146	910
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(マンデート方式)	-	-	-	-
	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	4,976	4,014	398	321
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	4,827	3,863	386	309
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	149	150	11	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	オペレーションナル・リスク	66,898	67,559	5,351	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	66,898	67,559	5,351	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	2,095,079	2,049,394	167,606	163,951

■OV1:リスク・アセットの概要 (2019年9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	1,965,488	1,924,670	157,239	153,973
2	うち、標準的手法適用分	1,928,699	1,885,944	154,295	150,875
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	36,789	38,725	2,943	3,098
4	カウンターパーティ信用リスク	642	916	51	73
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	422	538	33	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	134	221	10	17
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	—	—	—	—
	その他	85	156	6	12
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)	14,330	11,374	1,146	909
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(マンデート方式)	—	—	—	—
	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	4,976	4,014	398	321
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	4,827	3,863	386	309
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	149	150	11	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	オペレーションナル・リスク	62,682	62,873	5,014	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	62,682	62,873	5,014	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	2,048,121	2,003,850	163,849	160,308