

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2019年3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	1,946,312	1,941,553	155,705	155,324
2	うち、標準的手法適用分	1,908,619	1,901,127	152,689	152,090
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	37,693	40,425	3,015	3,234
4	カウンターパーティ信用リスク	687	875	54	70
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	327	426	26	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	128	206	10	16
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	38	-	3
	その他	231	204	18	16
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)	15,849		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)	-		-	
	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	4,050	16,447	324	1,315
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	3,900		312	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	150		12	
	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				
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分				
	うち、標準的手法適用分		3,944		315
	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	62,873	63,383	5,029	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	62,873	63,383	5,029	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	2,029,772	2,022,259	162,381	161,780

(注) 上記計表は、当四半期末(2019年3月末)より新開示告示が適用されているため、新開示告示の改正に基づき作成しております。

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (2019年3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	1,988,513	1,983,414	159,081	158,673
2	うち、標準的手法適用分	1,938,168	1,929,453	155,053	154,356
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	50,344	53,960	4,027	4,316
4	カウンターパーティ信用リスク	687	875	54	70
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	327	426	26	34
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	128	206	10	16
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	38	-	3
	その他	231	204	18	16
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)	15,853		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%)	-		-	
	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	4,050	16,447	324	1,315
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	3,900		312	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	150		12	
	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				
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分				
	うち、標準的手法適用分		3,944		315
	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	67,559	68,138	5,404	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	67,559	68,138	5,404	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	2,076,663	2,068,876	166,133	165,510

(注) 上記計表は、当四半期末(2019年3月末)より新開示告示が適用されているため、新開示告示の改正に基づき作成しております。