

■OV1:リスク・アセットの概要 (2019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	2,061,034	2,008,225	164,882	160,658
2	うち、標準的手法適用分	2,006,566	1,957,628	160,525	156,610
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	54,468	50,596	4,357	4,047
4	カウンターパーティ信用リスク	608	642	48	51
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	390	422	31	33
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	118	134	9	10
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	99	85	7	6
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)	15,907	14,335	1,272	1,146
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	6,924	4,976	553	398
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	6,775	4,827	542	386
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	149	149	11	11
	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	66,898	66,898	5,351	5,351
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	66,898	5,351	5,351
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	2,151,373	2,095,079	172,109	167,606

■OV1:リスク・アセットの概要 (2019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	2,018,622	1,965,488	161,489	157,239
2	うち、標準的手法適用分	1,978,569	1,928,699	158,285	154,295
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	40,053	36,789	3,204	2,943
4	カウンターパーティ信用リスク	608	642	48	51
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	390	422	31	33
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	118	134	9	10
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	-	-	-	-
	その他	99	85	7	6
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)	15,902	14,330	1,272	1,146
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	6,924	4,976	553	398
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	6,775	4,827	542	386
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	149	149	11	11
	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	62,682	62,682	5,014	5,014
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	62,682	5,014	5,014
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	2,104,740	2,048,121	168,379	163,849