

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018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	1,962,590	1,916,367	157,007	153,309
2	うち、標準的手法適用分	1,912,747	1,866,649	153,019	149,331
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	49,842	49,718	3,987	3,977
4	カウンターパーティ信用リスク	596	669	47	53
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	184	223	14	17
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	101	117	8	9
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	16	1	1
	その他	286	312	22	24
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	4,000	-	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	4,000	-	320	-
	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	68,138	69,381	5,451	5,550
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	69,381	5,451	5,550
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	2,035,325	1,986,418	162,826	158,913

■OV1:リスク・アセットの概要 (2018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	1,922,844	1,877,301	153,827	150,184
2	うち、標準的手法適用分	1,884,817	1,839,372	150,785	147,149
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	38,026	37,929	3,042	3,034
4	カウンターパーティ信用リスク	596	669	47	53
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	184	223	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	101	117	8	9
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	23	16	1	1
	その他	286	312	22	24
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	4,000	-	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	4,000	-	320	-
	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	63,383	63,933	5,070	5,114
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	63,933	5,070	5,114
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	1,990,823	1,941,904	159,265	155,352