

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (平成30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	1,921,335		153,706	
2	うち、標準的手法適用分	1,871,079		149,686	
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	50,255		4,020	
4	カウンターパーティ信用リスク	1,118		89	
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	505		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	247		19	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8		0	
	その他	356		28	
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	-		-	
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	-		-	
	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	69,381		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	69,381		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	1,991,835		159,346	

(注) 告示改正初年度であるため、前四半期末の計数は記載していません。

## ■OV1:リスク・アセットの概要 (平成30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	1,882,835		150,626	
2	うち、標準的手法適用分	1,828,405		146,272	
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	54,429		4,354	
4	カウンターパーティ信用リスク	1,118		89	
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	505		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	247		19	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8		0	
	その他	356		28	
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	-		-	
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	-		-	
	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	63,933		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	63,933		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	1,947,886		155,830	

(注) 告示改正初年度であるため、前四半期末の計数は記載していません。