

リスク・アセットの概要（2018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	4,194,604		400,005	
2	うち、標準的手法適用分	95,312		7,624	
3	うち、内部格付手法適用分	3,974,341		382,384	
	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	124,950		9,996	
4	カウンターパーティ信用リスク	83,861		6,885	
5	うち、S A－C C R適用分	-		-	
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	29,660		2,545	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、C V Aリスク	53,564		4,285	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	36		2	
	その他	599		52	
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	118,116		10,016	
	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	574,778		48,741	
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	5,645		478	
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	5,645		478	
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	12,672		1,013	
17	うち、標準的方式適用分	12,672		1,013	
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	294,669		23,573	
20	うち、基礎的手法適用分	-		-	
21	うち、粗利益配分手法適用分	294,669		23,573	
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	56,940		4,828	
	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	5,341,288		495,543	

【単体】

(単位：百万円)

0V1：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	4,177,492		398,289	
2	うち、標準的手法適用分	463		37	
3	うち、内部格付手法適用分	4,055,816		388,555	
	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	121,212		9,697	
4	カウンターパーティ信用リスク	83,830		6,883	
5	うち、S A - C C R適用分	-		-	
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	29,660		2,545	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、C V Aリスク	53,563		4,285	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	36		2	
	その他	568		49	
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	375,047		31,803	
	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	584,347		49,552	
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	5,645		478	
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	5,645		478	
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	12,560		1,004	
17	うち、標準的方式適用分	12,560		1,004	
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	254,214		20,337	
20	うち、基礎的手法適用分	-		-	
21	うち、粗利益配分手法適用分	254,214		20,337	
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	43,122		3,656	
	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	5,536,260		512,007	