

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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	4, 299, 445	4, 249, 050	363, 466	359, 186
2	うち、標準的手法適用分	99, 855	97, 767	7, 988	7, 821
3		4, 064, 837	4, 013, 094	344, 698	340, 310
		–	–	–	–
		–	–	–	–
		134, 751	138, 188	10, 780	11, 055
4	カウンターパーティ信用リスク	87, 340	82, 559	7, 130	6, 746
5	うち、S A－C C R適用分	–	–	–	–
		29, 276	29, 109	2, 482	2, 468
6		–	–	–	–
		57, 477	52, 883	4, 598	4, 230
		57	73	4	5
	その他	529	494	44	41
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	125, 858	118, 578	10, 672	10, 055
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）	487, 268		38, 981	
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（マンドेट方式）	39, 036		3, 122	
	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％）	3, 031		257	
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		555, 833		47, 134
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	24, 021	6, 528	1, 921	553
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		24, 021		1, 921	
15		–		–	
			6, 528		553
			–		–
			–		–
		–	–	–	–
16	マーケット・リスク	13, 027	15, 651	1, 042	1, 252
17	うち、標準的方式適用分	13, 027	15, 651	1, 042	1, 252
18		–	–	–	–
19	オペレーショナル・リスク	298, 063	296, 347	23, 845	23, 707
20	うち、基礎的手法適用分	–	–	–	–
21		298, 063	296, 347	23, 845	23, 707
22		–	–	–	–
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, 269	58, 723	4, 771	4, 979
	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, 433, 361	5, 383, 273	455, 211	453, 617

リスク・アセットの概要（2019年3月末）

（単位：百万円）

【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	
			2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク		4, 315, 431	4, 265, 940	365, 314	361, 096
2		うち、標準的手法適用分	315	796	25	63
3		うち、内部格付手法適用分	4, 183, 267	4, 129, 431	354, 741	350, 175
		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	131, 848	135, 712	10, 547	10, 856
4	カウンターパーティ信用リスク		87, 260	82, 518	7, 123	6, 743
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, 277	29, 109	2, 482	2, 468
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	57, 477	52, 883	4, 598	4, 230
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	57	73	4	5
		その他	447	452	37	38
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		360, 758	353, 729	30, 592	29, 996
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)		499, 069		39, 925	
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)		39, 036		3, 122	
	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%)		3, 031		257	
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			566, 065		48, 002
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		24, 021	6, 528	1, 921	553
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	24, 021		1, 921	
15		うち、標準的手法準拠方式適用分	－		－	
		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		6, 528		553
		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		－		－
		うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	－	－	－	－
16	マーケット・リスク		13, 007	15, 586	1, 040	1, 246
17		うち、標準的方式適用分	13, 007	15, 586	1, 040	1, 246
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		257, 039	255, 703	20, 563	20, 456
20		うち、基礎的手法適用分	－	－	－	－
21		うち、粗利益配分手法適用分	257, 039	255, 703	20, 563	20, 456
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	43, 122	3, 656	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, 641, 778	5, 589, 195	473, 517	471, 752