

リスク・アセットの概要 (2019年6月末)

【連結】

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	4,311,707	4,299,445	364,458	363,466
2	うち、標準的手法適用分	102,432	99,855	8,194	7,988
3	うち、内部格付手法適用分	4,067,008	4,064,837	344,882	344,698
	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	142,267	134,751	11,381	10,780
4	カウンターパーティ信用リスク	84,579	87,340	6,900	7,130
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	27,116	29,276	2,299	2,482
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	56,605	57,477	4,528	4,598
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	76	57	6	4
	その他	781	529	66	44
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	127,174	125,858	10,784	10,672
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)	430,575	487,268	34,446	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 (マンドート方式)	41,840	39,036	3,347	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%)	3,098	3,031	262	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%)	-	-	-	-
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	22,822	24,021	1,825	1,921
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	22,822	24,021	1,825	1,921
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	18,782	13,027	1,502	1,042
17	うち、標準的方式適用分	18,782	13,027	1,502	1,042
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	298,063	298,063	23,845	23,845
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	298,063	298,063	23,845	23,845
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	56,059	56,269	4,753	4,771
	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	5,394,705	5,433,361	452,126	455,211

リスク・アセットの概要 (2019年6月末)

【単体】

(単位：百万円)

OV1：リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	4,331,755	4,315,431	366,667	365,314
2	うち、標準的手法適用分	248	315	19	25
3	うち、内部格付手法適用分	4,193,080	4,183,267	355,573	354,741
	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	138,426	131,848	11,074	10,547
4	カウンターパーティ信用リスク	84,509	87,260	6,894	7,123
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	27,116	29,277	2,299	2,482
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	56,605	57,477	4,528	4,598
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	76	57	6	4
	その他	711	447	60	37
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	362,051	360,758	30,701	30,592
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)	441,449	499,069	35,315	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)	41,840	39,036	3,347	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%)	3,098	3,031	262	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%)	-	-	-	-
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	22,822	24,021	1,825	1,921
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	22,822	24,021	1,825	1,921
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	18,594	13,007	1,487	1,040
17	うち、標準的方式適用分	18,594	13,007	1,487	1,040
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	257,039	20,563	20,563
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	257,039	20,563	20,563
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	5,606,284	5,641,778	470,722	473,517