

リスク・アセットの概要（2018年6月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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	
		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	4,244,548	4,194,604	405,138	400,005
2	うち、標準的手法適用分	94,477	95,312	7,558	7,624
3	うち、内部格付手法適用分	4,012,094	3,974,341	386,541	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	137,976	124,950	11,038	9,996
4	カウンターパーティ信用リスク	84,975	83,861	6,977	6,885
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	30,298	29,660	2,598	2,545
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	53,910	53,564	4,312	4,285
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	107	36	8	2
	その他	658	599	57	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	125,145	118,116	10,612	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	586,061	574,778	49,698	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	5,374	5,645	455	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	5,374	5,645	455	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	15,835	12,672	1,266	1,013
17	うち、標準的方式適用分	15,835	12,672	1,266	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	294,669	23,573	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	294,669	23,573	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	57,577	56,940	4,882	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	5,414,190	5,341,288	502,604	495,543

リスク・アセットの概要（2018年6月末）

【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	4,228,345	4,177,492	403,309	398,289
2	うち、標準的手法適用分	572	463	45	37
3	うち、内部格付手法適用分	4,094,058	4,055,816	392,566	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	133,714	121,212	10,697	9,697
4	カウンターパーティ信用リスク	84,947	83,830	6,974	6,883
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	30,298	29,660	2,598	2,545
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	53,910	53,563	4,312	4,285
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	107	36	8	2
	その他	630	568	55	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	382,048	375,047	32,397	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	598,955	584,347	50,791	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	5,374	5,645	455	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	5,374	5,645	455	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	15,756	12,560	1,260	1,004
17	うち、標準的方式適用分	15,756	12,560	1,260	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	254,214	20,337	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	254,214	20,337	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	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	5,612,765	5,536,260	519,183	512,007