

リスク・アセットの概要 (2018年9月末)

【連結】

(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	
		2018年9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	4,258,876	4,244,548	360,029	358,821
2	うち、標準的手法適用分	95,880	94,477	7,670	7,558
3	うち、内部格付手法適用分	4,024,841	4,012,094	341,306	340,225
	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	138,154	137,976	11,052	11,038
4	カウンターパーティ信用リスク	80,432	84,975	6,574	6,946
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	28,542	30,298	2,420	2,569
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	51,173	53,910	4,093	4,312
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	37	107	2	8
	その他	679	658	57	55
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	116,429	125,145	9,873	10,612
	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	556,984	586,061	47,232	49,698
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	5,810	5,374	492	455
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	5,810	5,374	492	455
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	11,626	15,835	930	1,266
17	うち、標準的方式適用分	11,626	15,835	930	1,266
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	296,347	294,669	23,707	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	296,347	294,669	23,707	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	58,282	57,577	4,942	4,882
	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	5,384,789	5,414,190	453,782	456,257

リスク・アセットの概要（2018年9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	
		2018年9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
1	信用リスク	4,284,531	4,228,345	362,676	357,919
2	うち、標準的手法適用分	487	572	39	45
3	うち、内部格付手法適用分	4,148,828	4,094,058	351,820	347,176
	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	135,215	133,714	10,817	10,697
4	カウンターパーティ信用リスク	80,404	84,947	6,572	6,944
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	28,543	30,298	2,420	2,569
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	51,173	53,910	4,093	4,312
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	37	107	2	8
	その他	649	630	55	53
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	373,228	382,048	31,649	32,397
	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	567,288	598,955	48,106	50,791
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	5,810	5,374	492	455
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	5,810	5,374	492	455
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	11,498	15,756	919	1,260
17	うち、標準的方式適用分	11,498	15,756	919	1,260
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	255,703	254,214	20,456	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	255,703	254,214	20,456	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	5,621,588	5,612,765	474,530	473,762