

リスク・アセットの概要（2018年12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	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	4,249,050	4,258,876	359,186	360,029
2	うち、標準的手法適用分	97,767	95,880	7,821	7,670
3	うち、内部格付手法適用分	4,013,094	4,024,841	340,310	341,306
	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	138,188	138,154	11,055	11,052
4	カウンターパーティ信用リスク	82,559	80,432	6,746	6,574
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	29,109	28,542	2,468	2,420
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	52,883	51,173	4,230	4,093
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	73	37	5	2
	その他	494	679	41	57
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	118,578	116,429	10,055	9,873
	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	556,984	47,134	47,232
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	6,528	5,810	553	492
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	6,528	5,810	553	492
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	15,651	11,626	1,252	930
17	うち、標準的方式適用分	15,651	11,626	1,252	930
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	296,347	23,707	23,707
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	296,347	23,707	23,707
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	58,723	58,282	4,979	4,942
	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	5,383,273	5,384,789	453,617	453,782

リスク・アセットの概要（2018年12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12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	4,265,940	4,284,531	361,096	362,676
2	うち、標準的手法適用分	796	487	63	39
3	うち、内部格付手法適用分	4,129,431	4,148,828	350,175	351,820
	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	135,712	135,215	10,856	10,817
4	カウンターパーティ信用リスク	82,518	80,404	6,743	6,572
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	29,109	28,543	2,468	2,420
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	52,883	51,173	4,230	4,093
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	73	37	5	2
	その他	452	649	38	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	353,729	373,228	29,996	31,649
	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	567,288	48,002	48,106
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	6,528	5,810	553	492
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	6,528	5,810	553	492
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	15,586	11,498	1,246	919
17	うち、標準的方式適用分	15,586	11,498	1,246	919
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	255,703	20,456	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	255,703	255,703	20,456	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	5,589,195	5,621,588	471,752	474,530