

リスク・アセットの概要（2018年3月末・速報値）

【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		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年3月末	2017年12月末	2018年3月末	2017年12月末
1	信用リスク	4,941,951		418,300	
2	うち、標準的手法適用分	61,004		4,880	
3	うち、内部格付手法適用分	4,780,145		405,356	
	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	5,659		452	
	その他	95,142		7,611	
4	カウンターパーティ信用リスク	57,075		4,647	
5	うち、SA-CCR適用分	16,542		1,402	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、CVAリスク	39,963		3,197	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	72		5	
	その他	496		42	
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	147,785		12,532	
	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	530,107		44,953	
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	2,272		192	
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	831		70	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,440		122	
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	68,962		5,516	
17	うち、標準的方式適用分	68,962		5,516	
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	295,419		23,633	
20	うち、基礎的手法適用分	—		—	
21	うち、粗利益配分手法適用分	295,419		23,633	
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	25,385		2,152	
	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	760,872		60,869	
25	合計	6,829,832		572,799	

(注) 1. 上記は、平成 26 年金融庁告示第 7 号に基づく開示事項です。

2. 「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より 2015 年 1 月に公表された「開示要件（第 3 の柱）の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。
3. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じて得たリスク・アセットの額に 8% を乗じて得た額を記載しております。

【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		リスク・アセット		所要自己資本	
		2018年3月末	2017年12月末	2018年3月末	2017年12月末
1	信用リスク	4,925,028		417,096	
2	うち、標準的手法適用分	19,245		1,539	
3	うち、内部格付手法適用分	4,811,223		407,991	
	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	94,559		7,564	
4	カウンターパーティ信用リスク	57,075		4,647	
5	うち、SA-CCR適用分	16,542		1,402	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—		—	
	うち、CVAリスク	39,963		3,197	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	72		5	
	その他	496		42	
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	99,529		8,440	
	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	530,107		44,953	
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	2,272		192	
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	831		70	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,440		122	
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	68,408		5,472	
17	うち、標準的方式適用分	68,408		5,472	
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	275,921		22,073	
20	うち、基礎的手法適用分	—		—	
21	うち、粗利益配分手法適用分	275,921		22,073	
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	9,693		822	
	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	611,461		48,916	
25	合計	6,579,499		552,615	

(注) 1. 上記は、平成 26 年金融庁告示第 7 号に基づく開示事項です。

2. 「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より 2015 年 1 月に公表された「開示要件（第 3 の柱）の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。
3. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケーリング・ファクター（1.06）を乗じて得たリスク・アセットの額に 8% を乗じて得た額を記載しております。