

リスク・アセットの概要（2018年6月末）

【連結】

（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6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	4,952,436	4,941,951	419,198	418,300
2	うち、標準的手法適用分	60,215	61,004	4,817	4,880
3	うち、内部格付手法適用分	4,792,341	4,780,145	406,390	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	5,585	5,659	446	452
	その他	94,295	95,142	7,543	7,611
4	カウンターパーティ信用リスク	53,317	57,075	4,342	4,647
5	うち、SA-CCR適用分	15,508	16,542	1,315	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	36,801	39,963	2,944	3,197
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	474	72	37	5
	その他	532	496	45	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	167,255	147,785	14,183	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	588,710	530,107	49,922	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	1,551	2,272	131	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	112	831	9	70
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,439	1,440	122	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	92,339	68,962	7,387	5,516
17	うち、標準的方式適用分	92,339	68,962	7,387	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	295,419	23,633	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	295,419	23,633	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	26,566	25,385	2,252	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	767,786	760,872	61,422	60,869
25	合計	6,945,384	6,829,832	582,474	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ルリング・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ルリング・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6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	4,945,743	4,925,028	418,849	417,096
2	うち、標準的手法適用分	20,843	19,245	1,667	1,539
3	うち、内部格付手法適用分	4,831,170	4,811,223	409,683	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	93,729	94,559	7,498	7,564
4	カウンターパーティ信用リスク	53,317	57,075	4,342	4,647
5	うち、SA-CCR適用分	15,508	16,542	1,315	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	36,801	39,963	2,944	3,197
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	474	72	37	5
	その他	532	496	45	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	114,618	99,529	9,719	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	588,710	530,107	49,922	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	1,551	2,272	131	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	112	831	9	70
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,439	1,440	122	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	91,842	68,408	7,347	5,472
17	うち、標準的方式適用分	91,842	68,408	7,347	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	275,921	22,073	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	275,921	22,073	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	9,868	9,693	836	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	611,245	611,461	48,899	48,916
25	合計	6,692,819	6,579,499	562,123	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ルン・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ルン・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。