

リスク・アセットの概要（2018年9月末・速報値）

【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	4,941,491	4,952,436	418,225	419,198
2	うち、標準的手法適用分	58,769	60,215	4,701	4,817
3	うち、内部格付手法適用分	4,772,022	4,792,341	404,667	406,390
	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	5,770	5,585	461	446
	その他	104,929	94,295	8,394	7,543
4	カウンターパーティ信用リスク	61,909	53,317	5,040	4,342
5	うち、SA-CCR適用分	17,653	15,508	1,496	1,315
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	43,598	36,801	3,487	2,944
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	93	474	7	37
	その他	565	532	47	45
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	160,581	167,255	13,617	14,183
	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	584,254	588,710	49,544	49,922
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	1,421	1,551	120	131
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	88	112	7	9
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,333	1,439	113	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	68,662	92,339	5,493	7,387
17	うち、標準的方式適用分	68,662	92,339	5,493	7,387
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	295,430	295,419	23,634	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	295,430	295,419	23,634	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	26,670	26,566	2,261	2,252
	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	923,390	767,786	73,871	61,422
25	合計	7,063,815	6,945,384	591,808	582,474

(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	4,935,639	4,945,743	417,936	418,849
2	うち、標準的手法適用分	21,865	20,843	1,749	1,667
3	うち、内部格付手法適用分	4,809,414	4,831,170	407,838	409,683
	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	104,358	93,729	8,348	7,498
4	カウンターパーティ信用リスク	61,909	53,317	5,040	4,342
5	うち、SA-CCR適用分	17,652	15,508	1,496	1,315
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	43,598	36,801	3,487	2,944
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	93	474	7	37
	その他	565	532	47	45
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	112,357	114,618	9,527	9,719
	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	584,254	588,710	49,544	49,922
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	1,421	1,551	120	131
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	88	112	7	9
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,333	1,439	113	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	68,086	91,842	5,446	7,347
17	うち、標準的方式適用分	68,086	91,842	5,446	7,347
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	276,774	275,921	22,141	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	276,774	275,921	22,141	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	10,035	9,868	851	836
	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	760,794	611,245	60,863	48,899
25	合計	6,811,273	6,692,819	571,473	562,123

(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。