

リスク・アセットの概要（2018年12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		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	4,962,793	4,941,491	419,999	418,225
2	うち、標準的手法適用分	66,396	58,769	5,311	4,701
3	うち、内部格付手法適用分	4,786,603	4,772,022	405,903	404,667
	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	5,876	5,770	470	461
	その他	103,917	104,929	8,313	8,394
4	カウンターパーティ信用リスク	60,087	61,909	4,898	5,040
5	うち、SA-CCR適用分	18,367	17,653	1,557	1,496
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	40,995	43,598	3,279	3,487
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	82	93	6	7
	その他	642	565	54	47
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	154,742	160,581	13,122	13,617
	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	523,831	584,254	44,420	49,544
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	1,383	1,421	117	120
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	79	88	6	7
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,304	1,333	110	113
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	70,456	68,662	5,636	5,493
17	うち、標準的方式適用分	70,456	68,662	5,636	5,493
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	295,430	23,634	23,634
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	295,430	23,634	23,634
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	27,064	26,670	2,295	2,261
	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	1,104,529	923,390	88,362	73,871
25	合計	7,200,318	7,063,815	602,486	591,808

(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、パ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・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・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		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	4,952,492	4,935,639	419,350	417,936
2	うち、標準的手法適用分	25,932	21,865	2,074	1,749
3	うち、内部格付手法適用分	4,823,232	4,809,414	409,010	407,838
	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	103,328	104,358	8,266	8,348
4	カウンターパーティ信用リスク	60,085	61,909	4,898	5,040
5	うち、SA-CCR適用分	18,367	17,652	1,557	1,496
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	40,995	43,598	3,279	3,487
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	80	93	6	7
	その他	642	565	54	47
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	110,837	112,357	9,399	9,527
	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	523,831	584,254	44,420	49,544
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	1,383	1,421	117	120
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	79	88	6	7
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	1,304	1,333	110	113
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	69,605	68,086	5,568	5,446
17	うち、標準的方式適用分	69,605	68,086	5,568	5,446
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	276,774	22,141	22,141
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	276,774	22,141	22,141
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	10,566	10,035	896	851
	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	939,814	760,794	75,185	60,863
25	合計	6,945,391	6,811,273	581,977	571,473

(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、パ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。