

リスク・アセットの概要（2019年3月末・速報値）

【連結】

（単位：百万円）

OV1：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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	4,982,184	4,962,793	421,687	419,999
2	うち、標準的手法適用分	58,490	66,396	4,679	5,311
3	うち、内部格付手法適用分	4,815,205	4,786,603	408,329	405,903
	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	6,060	5,876	484	470
	その他	102,427	103,917	8,194	8,313
4	カウンターパーティ信用リスク	57,330	60,087	4,679	4,898
5	うち、SA-CCR適用分	18,804	18,367	1,594	1,557
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	37,632	40,995	3,010	3,279
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	380	82	30	6
	その他	512	642	43	54
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	157,336	154,742	13,342	13,122
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	553,584		46,741	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	37,640		3,011	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	2,370		189	
	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		44,420
	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	1,565	1,383	125	117
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,369		109	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	196		15	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		6
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		1,304		110
	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	72,804	70,456	5,824	5,636
17	うち、標準的方式適用分	72,804	70,456	5,824	5,636
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	294,918	295,430	23,593	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	294,918	295,430	23,593	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	27,618	27,064	2,342	2,295
	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	1,068,566	1,104,529	85,485	88,362
25	合計	7,255,921	7,200,318	607,021	602,486

(注) 1. 上記計表は当期末より新告示が適用されているため新告示の改正事項を反映し、作成しております。

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		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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	4,974,852	4,952,492	421,276	419,350
2	うち、標準的手法適用分	21,272	25,932	1,701	2,074
3	うち、内部格付手法適用分	4,851,719	4,823,232	411,425	409,010
	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	101,861	103,328	8,148	8,266
4	カウンターパーティ信用リスク	57,330	60,085	4,679	4,898
5	うち、SA-CCR適用分	18,804	18,367	1,594	1,557
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	37,632	40,995	3,010	3,279
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	380	80	30	6
	その他	512	642	43	54
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	112,247	110,837	9,518	9,399
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	553,584		46,741	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	37,640		3,011	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	2,370		189	
	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		44,420
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	1,565	1,383	125	117
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,369		109	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	196		15	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	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		6
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		1,304		110
	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	71,912	69,605	5,752	5,568
17	うち、標準的方式適用分	71,912	69,605	5,752	5,568
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	276,083	276,774	22,086	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	276,083	276,774	22,086	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	10,550	10,566	894	896
	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	883,921	939,814	70,713	75,185
25	合計	6,982,061	6,945,391	584,989	581,977

(注) 1. 上記計表は当期末より新告示が適用されているため新告示の改正事項を反映し、作成しております。

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。