

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OVI:リスク・アセットの概要		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	3,548,218	3,575,791	300,290	302,587
2	うち、標準的手法適用分	38,090	36,183	3,047	2,894
3	うち、内部格付手法適用分	3,388,008	3,417,442	287,473	289,919
	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	1,050	1,028	84	82
	その他	121,069	121,135	9,685	9,690
4	カウンターパーティー信用リスク	30,908	30,713	2,558	2,547
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	13,773	11,319	1,168	959
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	13,010	11,714	1,040	937
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	120	142	9	11
	その他	4,003	7,536	339	639
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	107,753	121,923	9,137	10,339
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)	313,966	316,848	25,077	25,316
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(マニデート方式)	38,237	44,794	2,992	3,517
	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%)	1,590	-	83	-
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	27,225	27,743	2,178	2,219
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	21,566	21,649	1,725	1,731
14	うち、外部格付準拠方式適用分	3,145	3,349	251	267
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,000	1,023	80	81
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,514	1,720	121	137
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
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	189,228	189,228	15,138	15,138
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	189,228	189,228	15,138	15,138
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	14,975	14,933	1,269	1,266
	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	-	-	-	-
25	合計	4,272,105	4,321,974	358,725	362,931

(注) 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。