

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第四号第一面)

(単位:百万円)

OV1: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	1,872,761	1,874,503	158,553	158,685
2	うち、標準的手法適用分	8,826	12,008	706	960
3	うち、内部格付手法適用分	1,803,844	1,802,737	153,039	152,944
	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	60,089	59,758	4,807	4,780
4	カウンターパーティー信用リスク	45,672	40,300	3,808	3,360
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	11,010	12,051	933	1,021
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	13,081	11,824	1,046	945
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	279	120	22	9
	その他	21,301	16,304	1,806	1,382
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	42,374	50,058	3,593	4,244
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)	216,017	236,003	17,197	18,787
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)	20,403	22,713	1,563	1,774
	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%)	36	404	-	-
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	3,756	3,930	300	314
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	2,755	2,929	220	234
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,000	1,000	80	80
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
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	88,580	89,903	7,086	7,192
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	88,580	89,903	7,086	7,192
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	8,583	8,507	727	721
	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	2,298,187	2,326,324	192,831	195,080

(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。