

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 国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	3,582,168	3,548,218	303,196	300,290
2	うち、標準的手法適用分	32,708	38,090	2,616	3,047
3	うち、内部格付手法適用分	3,425,224	3,388,008	290,640	287,473
	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	1,104	1,050	88	84
	その他	123,130	121,069	9,850	9,685
4	カウンターパーティー信用リスク	43,642	30,908	3,629	2,558
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	12,937	13,773	1,097	1,168
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	14,509	13,010	1,160	1,040
	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	15,915	4,003	1,349	339
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	103,045	107,753	8,738	9,137
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)	303,848	313,966	24,269	25,077
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)	43,820	38,237	3,392	2,992
	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	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	26,540	27,225	2,123	2,178
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	21,316	21,566	1,705	1,725
14	うち、外部格付準拠方式適用分	2,939	3,145	235	251
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	1,284	1,514	102	121
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	186,385	189,228	14,910	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	186,385	189,228	14,910	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	19,751	14,975	1,674	1,269
	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	4,309,239	4,272,105	361,936	358,725

(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。