

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第二号第一面)

(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		2018年3月末	2017年12月末	2018年3月末	2017年12月末
1	信用リスク	3,500,899		296,319	
2	うち、標準的手法適用分	29,286		2,342	
3	うち、内部格付手法適用分	3,334,740		282,976	
	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	136,872		11,000	
4	カウンターパーティー信用リスク	60,467		5,079	
5-1	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	13,519		1,146	
5-2	うち、標準方式適用分	-		-	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	9,982		798	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	149		11	
	その他	36,816		3,122	
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	65		5	
	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	478,968		40,616	
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	30,122		2,554	
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	24,200		2,052	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-		-	
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	5,922		502	
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	191,696		15,335	
20	うち、基礎的手法適用分	-		-	
21	うち、粗利益配分手法適用分	191,696		15,335	
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	10,674		905	
	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	4,272,896		360,816	

(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。