

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)

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	
		2018年12月末	2018年9月末	2018年12月末	2018年9月末
1	信用リスク	1,857,190	1,836,649	157,225	155,504
2	うち、標準的手法適用分	9,941	5,665	795	453
3	うち、内部格付手法適用分	1,766,253	1,753,995	149,849	148,808
	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	80,995	76,988	6,581	6,241
4	カウンターパーティー信用リスク	35,353	31,578	2,954	2,641
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	8,623	6,996	731	593
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	9,009	7,321	720	585
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	142	149	11	11
	その他	17,578	17,110	1,490	1,450
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	50	51	4	4
	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	265,987	180,789	22,555	15,330
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	1,042	715	88	60
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	1,042	715	88	60
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	-	-	-	-
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	90,129	90,129	7,210	7,210
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	90,129	90,129	7,210	7,210
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	7,182	7,181	609	608
	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	2,256,937	2,147,095	190,647	181,361

(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。