

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		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	3,547,171	3,520,222	300,224	297,952
2	うち、標準的手法適用分	45,089	30,528	3,607	2,442
3	うち、内部格付手法適用分	3,385,983	3,362,188	287,329	285,309
	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	1,002	929	80	74
	その他	115,096	126,576	9,207	10,126
4	カウンターパーティー信用リスク	26,851	28,305	2,227	2,359
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	10,297	8,653	873	733
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	10,150	8,398	812	671
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	143	156	11	12
	その他	6,259	11,096	530	940
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	2,273	2,761	192	234
	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	462,162	294,069	39,191	24,937
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	26,662	26,752	2,261	2,268
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	24,630	24,475	2,088	2,075
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	2,032	2,277	172	193
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	190,915	190,915	15,273	15,273
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	190,915	190,915	15,273	15,273
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	13,093	13,125	1,110	1,113
	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	4,269,131	4,076,151	360,481	344,137

(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。