

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)

国際様式の 該当番号	リスク・アセットの概要	リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	1,874,118	1,857,190	158,632	157,225
2	うち、標準的手法適用分	9,212	9,941	736	795
3	うち、内部格付手法適用分	1,805,243	1,766,253	153,122	149,849
	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	59,662	80,995	4,773	6,581
4	カウンターパーティー信用リスク	36,230	35,353	3,021	2,954
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	9,588	8,623	813	731
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	10,454	9,009	836	720
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	142	142	11	11
	その他	16,044	17,578	1,360	1,490
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	54,495	50	4,621	4
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)	223,050	-	17,739	-
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)	26,897	-	2,108	-
	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%)	-	-	-	-
	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	-	22,555
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	4,123	1,042	329	88
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	3,099	-	247	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,023	-	81	-
	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	-	88
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
	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	89,903	90,129	7,192	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	89,903	90,129	7,192	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	8,472	7,182	718	609
	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	2,317,291	2,256,937	194,364	190,647

(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。