

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		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	3,575,791	3,547,171	302,587	300,224
2	うち、標準的手法適用分	36,183	45,089	2,894	3,607
3	うち、内部格付手法適用分	3,417,442	3,385,983	289,919	287,329
	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	1,028	1,002	82	80
	その他	121,135	115,096	9,690	9,207
4	カウンターパーティー信用リスク	30,713	26,851	2,547	2,227
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	11,319	10,297	959	873
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	11,714	10,150	937	812
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	142	143	11	11
	その他	7,536	6,259	639	530
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	121,923	2,273	10,339	192
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)	316,848	-	25,316	-
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)	44,794	-	3,517	-
	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	-	462,162	-	39,191
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	27,743	26,662	2,219	2,261
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	21,649	-	1,731	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	3,349	-	267	-
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	-	24,630	-	2,088
	うち、内部格付手法における指定回数方式適用分	-	-	-	-
	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,720	2,032	137	172
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	189,228	190,915	15,138	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	189,228	190,915	15,138	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	14,933	13,093	1,266	1,110
	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	4,321,974	4,269,131	362,931	360,481

(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。