

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	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	1,874,503	1,874,118	158,685	158,632
2	うち、標準的手法適用分	12,008	9,212	960	736
3	うち、内部格付手法適用分	1,802,737	1,805,243	152,944	153,122
	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	59,758	59,662	4,780	4,773
4	カウンターパーティー信用リスク	40,300	36,230	3,360	3,021
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	12,051	9,588	1,021	813
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	11,824	10,454	945	836
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	120	142	9	11
	その他	16,304	16,044	1,382	1,360
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	50,058	54,495	4,244	4,621
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)	236,003	223,050	18,787	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(マナド方式)	22,713	26,897	1,774	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%)	404	-	-	-
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	3,930	4,123	314	329
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	2,929	3,099	234	247
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,000	1,023	80	81
	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	89,903	7,192	7,192
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	89,903	7,192	7,192
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	8,507	8,472	721	718
	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	2,326,324	2,317,291	195,080	194,364

(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。