

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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	3,622,961	3,582,168	303,652	303,196
2	うち、標準的手法適用分	43,679	32,708	3,494	2,616
3	うち、内部格付手法適用分	3,456,819	3,425,224	290,360	290,640
	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	1,113	1,104	89	88
	その他	121,349	123,130	9,707	9,850
4	カウンターパーティー信用リスク	35,021	43,642	2,885	3,629
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	13,673	12,937	1,159	1,097
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	17,316	14,509	1,385	1,160
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	292	279	23	22
	その他	3,739	15,915	317	1,349
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	64,601	103,045	5,478	8,738
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)	302,944	303,848	24,198	24,269
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)	38,289	43,820	2,950	3,392
	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%)	31,836	36	2,544	-
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	25,815	26,540	2,065	2,123
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	20,902	21,316	1,672	1,705
14	うち、外部格付準拠方式適用分	2,776	2,939	222	235
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,000	1,000	80	80
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	1,135	1,284	90	102
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	186,385	186,385	14,910	14,910
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	186,385	186,385	14,910	14,910
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	15,546	19,751	1,318	1,674
	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	36,899	-	2,951	-
25	合計	4,360,302	4,309,239	362,955	361,936

(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。