

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)

OVI: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		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	1,932,201	1,930,965	163,593	163,465
2	うち、標準的手法適用分	9,255	13,875	740	1,110
3	うち、内部格付手法適用分	1,856,436	1,857,018	157,532	157,549
	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	66,508	60,071	5,320	4,805
4	カウンターパーティー信用リスク	66,591	44,325	5,569	3,680
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	13,267	11,877	1,125	1,007
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	15,864	16,043	1,269	1,283
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	277	292	22	23
	その他	37,182	16,111	3,153	1,366
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	27,704	37,509	2,349	3,180
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(リスク・スルー方式)	312,698	212,460	24,921	16,885
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(マンデート方式)	45,667	17,806	3,586	1,355
	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%)	56	36	-	-
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	4,156	3,615	332	289
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	3,125	2,615	250	209
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,030	1,000	82	80
	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	90,019	88,580	7,201	7,086
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損利益配分手法適用分	90,019	88,580	7,201	7,086
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	24,089	8,583	2,042	727
	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	2,503,184	2,343,884	209,597	196,671

(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。