

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	3,627,824	3,622,961	307,070	303,652
2	うち、標準的手法適用分	33,089	43,679	2,647	3,494
3	うち、内部格付手法適用分	3,456,082	3,456,819	293,331	290,360
	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	1,165	1,113	93	89
	その他	137,487	121,349	10,998	9,707
4	カウンターパーティー信用リスク	81,737	35,021	6,843	2,885
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	15,961	13,673	1,353	1,159
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	18,082	17,316	1,446	1,385
	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	47,416	3,739	4,020	317
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	48,484	64,601	4,111	5,478
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)	454,183	302,944	36,299	24,198
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)	94,144	38,289	7,422	2,950
	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%)	1,495	31,836	106	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	26,527	25,815	2,122	2,065
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	20,091	20,902	1,607	1,672
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,527	2,776	362	222
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	878	1,135	70	90
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	185,753	186,385	14,860	14,910
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損利益配分手法適用分	185,753	186,385	14,860	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	65,543	15,546	5,558	1,318
	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	4,585,695	4,360,302	384,393	362,955

(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。