

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の該当番号		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	1,951,717	1,932,201	165,253	163,593
2	うち、標準的手法適用分	8,363	9,255	669	740
3	うち、内部格付手法適用分	1,879,939	1,856,436	159,511	157,532
	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	63,414	66,508	5,073	5,320
4	カウンターパーティー信用リスク	85,442	66,591	7,165	5,569
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	13,779	13,267	1,188	1,125
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,362	15,864	1,309	1,269
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	293	277	23	22
	その他	55,007	37,182	4,664	3,153
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	50,916	27,704	4,317	2,349
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)	501,942	312,898	40,094	24,921
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)	6,084	45,667	293	3,586
	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%)	1,937	56	-	-
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	3,028	4,156	242	332
13	うち、内部格付標準方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付標準方式適用分	3,028	3,125	242	250
15	うち、標準的手法標準方式適用分	0	1,030	0	82
	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	90,019	7,201	7,201
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	90,019	7,201	7,201
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	35,069	24,089	2,973	2,042
	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	2,726,158	2,503,184	227,542	209,597

(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。