

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	3,744,562	3,627,824	316,967	307,070
2	うち、標準的手法適用分	34,086	33,089	2,726	2,647
3	うち、内部格付手法適用分	3,576,413	3,456,082	303,515	293,331
	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値のエクスポージャー	1,209	1,165	96	93
	その他	132,852	137,487	10,628	10,998
4	カウンターパーティー信用リスク	112,268	81,737	9,428	6,843
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	16,551	15,961	1,403	1,353
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	18,909	18,082	1,512	1,446
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	294	277	23	22
	その他	76,514	47,416	6,488	4,020
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	8,808	48,484	746	4,111
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)	665,664	454,183	53,173	36,299
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)	47,172	94,144	3,535	7,422
	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%)	6,668	1,495	232	106
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	25,131	26,527	2,010	2,122
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	20,031	20,091	1,602	1,607
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,405	4,527	352	362
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	0	1,030	0	82
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	694	878	55	70
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	185,753	14,860	14,860
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	185,753	14,860	14,860
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	80,104	65,543	6,792	5,558
	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	4,876,135	4,585,695	407,746	384,393

(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。