リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号, 附則別紙様式第四号第一面) (単位:百万円)

1	所要自己 2020年9月末 166,516 416	2020年6月末 165,253
1 信用リスク 1,966,423 1,951,717 2 うち、標準的手法適用分 5,202 8,363 3 うち、内部格付手法適用分 1,898,952 1,879,939 うち、原動体付手法適用分 - - - うち、見み取引における見積残存価額のエクスポージャー - - - その他 62,267 63,414 4 カウンターパーティー信用リスク 54,466 85,442 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 14,382 13,779 うち、財待エクスポージャー方式適用分 - - うち、以入ノウスクラスポージャー 294 293 その他 23,426 55,007 7 マーケット・ベース方式に基づく検式等エクスポージャー 294 293 その他 23,426 55,007 7 マーケット・ベース方式に基づく検式等エクスポージャー 21,357 50,916 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(複然性方式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(養然性方式400%) - - 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(養然性方式400%) - -	166,516 416	
2 うち、標準的手法適用分 5.202 8.363 3 うち、内部格付手法適用分 1.898.952 1.879.939 うち、重要な出資のエクスポージャー - - さた、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 62.267 63.414 4 カウンターパーティー信用リスク 54.466 85.442 5 55、SA - CCR適用分 - - うち、SA-CCR適用分 14.382 13.779 6 うち、加やナ・エクスポージャー方式適用分 - - うち、BMキエクスポージャー方式適用分 - - うち、CVAリスク 16.363 16.362 うち、中央清算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23.426 55.007 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 21.357 50.916 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(マンテート方式) 6.967 6.084 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(基然性方式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(基然性方式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(基務性方式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(基準であると対しますとは信用リスク・アセットのみなし計算(基準であると対しますとは信用などのよりますとは信用などのよりますとは信用などのよりますとは信用などのよりますとは信用などのよりますとはなりますとはなりによりますとはなりますとはなりますとはなりますとはなりますとはなりますとはなりまする	416	100,20
3 うち、内部格付手法適用分 1.898.952 1.879.939 うち、重要な出資のエクスポージャー - - さた、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 62.267 63.414 4 カウンターパーティー信用リスク 54.466 85.442 5 55、SA - CCR適用分 - - うち、Nレント・エクスポージャー方式適用分 14.382 13.779 6 55、財待エクスポージャー方式適用分 - - うち、EVAリスク 16.363 16.362 うち、中央清算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23.426 55.007 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 21.357 50.916 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(アセットのみなし計算(マンデート方式) 359.798 501.942 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(運然性方式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(運然性方式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(運然性方式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(蓄然性方式2400%) - -		66
うち、重要な出資のエクスポージャー -	161,119	159,51
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 62,267 63,414 4 カウンターパーティー信用リスク 54,466 85,442 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 14,382 13,779 6 うち、服存エクスポージャー方式適用分 - - うち、EVAリスク 16,363 16,362 うち、中央消算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23,426 55,007 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 21,357 50,916 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(レック・スルー方式) 359,798 501,942 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) 6,967 6,084 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(養然性方式400%) - -	_	
4 カウンターパーティー信用リスク 54.466 85.442 5 うち、SA-CCR適用分 - - 6 うち、カレント・エクスポージャー方式適用分 14.382 13.779 6 うち、脱待エクスポージャー方式適用分 - - うち、CVAリスク 16.363 16.362 うち、中央清算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23.426 55.007 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 21.357 50.916 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(レック・スルー方式) 359.798 501.942 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(ダンデート方式) 6.967 6.084 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250%) - -	4,981	5,07
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 14,382 13,779 うち、期待エクスポージャー方式適用分 - - うち、以及リスク 16,363 16,362 うち、中央清算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23,426 55,007 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 21,357 50,916 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(パック・スルー方式) 359,798 501,942 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) 6,967 6,084 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%) - -	4,538	7,16
14,382 13,779 14,382 13,779 14,382 13,779 14,382 13,779 155、加シント・エクスポージャー方式適用分 - -	4,000	7.13
6 うち、脱待エクスポージャー方式適用分 - - - うち、CVAリスク 16,363 16,362 うち、中央消算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23,426 55,007 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 21,357 50,916 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) 359,798 501,942 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) 6,967 6,084 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%) - -	1,219	1,16
うち、CVAリスク 16.363 16.362 うち、中央清算機関関連エクスポージャー 294 293 その他 23.426 55.007 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 21.357 50.916 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) 359.798 501.942 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) 6.967 6.084 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%) - -	1,210	
うち、中央清算機関関連エクスポージャー その他 293 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 21,357 50,916 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) 359,798 501,942 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(センデート方式) 6,967 6,084 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%) - -	1,309	1,30
その他 23.426 55.007 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 21.357 50.916 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) 359.798 501.942 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(センテート方式) 6.967 6.084 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%) - -	23	1,00
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 21.357 50.916 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) 359,798 501.942 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) 6.967 6.084 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(塗然性方式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(塗然性方式260%)	1,986	4,60
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) 359,798 501,942 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) 6,967 6,084 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250%)	1,811	4,3
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) 6,967 6,084 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%)	28,733	40.0
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%)	291	29
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%)	251	
	_	
10 リスプ・フェーロのかなじ計算人は信用リスプ・アピットのかなじ計算(フォールバッフガス 1230%) 1,051 1,051		
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 4,140 3,028	331	24
12 13 うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分 -	331	
14 うち、外部格付準拠方式適用分 4,140 3,028	331	24
15 うち、標準的手法準拠方式適用分	331	24
75、保年的子法年拠月 X 週 用 ガ	_	
16 マーケット・リスク	_	
17	_	
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 90.871 90.019	7,269	7,2
20 うち、基礎的手法適用分	7,269	
	7,000	7.0
21 うち、粗利益配分手法適用分 90.871 90.019 22 うち、先進的計測手法適用分 - -	7,269	7,20
	2740	2,9
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 32,421 35,069	2,749	2,9
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 2,537,538 2,726,158	212,241	227,54

⁽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。