

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)

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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	3,696,046	3,744,562	312,876	316,967
2	うち、標準的手法適用分	29,745	34,086	2,379	2,726
3	うち、内部格付手法適用分	3,532,549	3,576,413	299,796	303,515
	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	1,209	1,209	96	96
	その他	132,541	132,852	10,603	10,628
4	カウンターパーティー信用リスク	73,437	112,268	6,133	9,428
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	16,864	16,551	1,430	1,403
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	19,384	18,909	1,550	1,512
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	294	294	23	23
	その他	36,893	76,514	3,128	6,488
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	41,708	8,808	3,536	746
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)	480,304	665,664	38,353	53,173
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(マニフェット方式)	48,932	47,172	3,544	3,535
	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%)	2,307	6,668	-	232
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	26,540	25,131	2,123	2,010
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	19,820	20,031	1,585	1,602
14	うち、外部格付準拠方式適用分	6,242	4,405	499	352
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	0	-	0
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	477	694	38	55
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	183,577	185,753	14,686	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	183,577	185,753	14,686	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	80,828	80,104	6,854	6,792
	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	4,633,682	4,876,135	388,108	407,746

(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。