

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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	1,999,875	1,966,423	169,331	166,516
2	うち、標準的手法適用分	10,028	5,202	802	416
3	うち、内部格付手法適用分	1,927,245	1,898,952	163,520	161,119
	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	62,601	62,267	5,008	4,981
4	カウンターパーティー信用リスク	37,774	54,466	3,110	4,538
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	16,882	14,382	1,431	1,219
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	19,119	16,363	1,529	1,309
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	307	294	24	23
	その他	1,464	23,426	124	1,986
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	21,357	4	1,811
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)	424,405	359,798	33,891	28,733
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(マンドート方式)	6,316	6,967	258	291
	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%)	1,091	1,091	-	-
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	3,872	4,140	309	331
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	3,872	4,140	309	331
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	90,871	90,871	7,269	7,269
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	90,871	90,871	7,269	7,269
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	33,856	32,421	2,871	2,749
	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	2,598,113	2,537,538	217,046	212,241

(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。