

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)

国際様式の 該当番号	OV1:リスク・アセットの概要	リスク・アセット		所要自己資本	
		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	3,747,196	3,696,046	317,173	312,876
2	うち、標準的手法適用分	38,622	29,745	3,089	2,379
3	うち、内部格付手法適用分	3,575,629	3,532,549	303,448	299,796
	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	1,254	1,209	100	96
	その他	131,690	132,541	10,535	10,603
4	カウンターパーティー信用リスク	46,196	73,437	3,811	6,133
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	19,497	16,864	1,653	1,430
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	21,780	19,384	1,742	1,550
	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	4,610	36,893	391	3,128
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	30,332	41,708	2,572	3,536
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)	554,296	480,304	44,263	38,353
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)	46,118	48,932	3,348	3,544
	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%)	14,511	2,307	987	-
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	26,089	26,540	2,087	2,123
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	19,679	19,820	1,574	1,585
14	うち、外部格付準拠方式適用分	5,951	6,242	476	499
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	458	477	36	38
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	183,577	14,686	14,686
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	183,577	183,577	14,686	14,686
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	79,348	80,828	6,728	6,854
	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	4,727,666	4,633,682	395,658	388,108

(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。