

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		2018年6月末	2018年3月末	2018年6月末	2018年3月末
1	信用リスク	3,494,629	3,498,049	295,770	296,078
2	うち、標準的手法適用分	32,851	29,286	2,628	2,342
3	うち、内部格付手法適用分	3,334,921	3,331,891	282,994	282,734
	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	847	-	67	-
	その他	126,008	136,872	10,080	11,000
4	カウンターパーティー信用リスク	30,540	60,467	2,553	5,079
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	9,187	13,519	779	1,146
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	7,464	9,982	597	798
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	152	149	12	11
	その他	13,736	36,816	1,164	3,122
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	3,155	2,915	267	247
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	625,546	478,968	53,046	40,616
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	28,359	30,122	2,404	2,554
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	23,919	24,200	2,028	2,052
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	4,439	5,922	376	502
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	191,696	191,696	15,335	15,335
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	191,696	191,696	15,335	15,335
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	13,293	10,674	1,127	905
	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	4,387,221	4,272,896	370,505	360,816

(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。