

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)

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9月末	2018年6月末	2018年9月末	2018年6月末
		1	信用リスク	1,836,649	1,869,877
2	うち、標準的手法適用分	5,665	7,065	453	565
3	うち、内部格付手法適用分	1,753,995	1,773,590	148,808	150,469
	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	76,988	89,221	6,241	7,279
4	カウンターパーティー信用リスク	31,578	34,785	2,641	2,919
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	6,996	7,045	593	597
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	7,321	6,230	585	498
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	149	152	11	12
	その他	17,110	21,356	1,450	1,811
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	51	51	4	4
	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	180,789	363,758	15,330	30,846
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	715	845	60	71
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	715	542	60	46
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	-	302	-	25
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	90,129	90,796	7,210	7,263
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	90,129	90,796	7,210	7,263
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	7,181	7,314	608	620
	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	2,147,095	2,367,223	181,361	200,039

(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。