

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	3,520,222	3,494,629	297,952	295,770
2	うち、標準的手法適用分	30,528	32,851	2,442	2,628
3	うち、内部格付手法適用分	3,362,188	3,334,921	285,309	282,994
	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	929	847	74	67
	その他	126,576	126,008	10,126	10,080
4	カウンターパーティー信用リスク	28,305	30,540	2,359	2,553
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	8,653	9,187	733	779
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	8,398	7,464	671	597
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	156	152	12	12
	その他	11,096	13,736	940	1,164
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	2,761	3,155	234	267
	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	294,069	625,546	24,937	53,046
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	26,752	28,359	2,268	2,404
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	24,475	23,919	2,075	2,028
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	2,277	4,439	193	376
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	190,915	191,696	15,273	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	190,915	191,696	15,273	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	13,125	13,293	1,113	1,127
	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	4,076,151	4,387,221	344,137	370,505

(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。