

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 国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	2,012,312	2,077,719	170,362	175,950
2	うち、標準的手法適用分	16,915	7,891	1,353	631
3	うち、内部格付手法適用分	1,936,636	2,010,868	164,308	170,602
	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	58,761	58,959	4,700	4,716
4	カウンターパーティー信用リスク	79,067	80,185	6,605	6,695
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	16,499	16,647	1,399	1,411
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	20,456	21,493	1,636	1,719
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	282	302	22	24
	その他	41,828	41,742	3,547	3,539
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	97,507	51	8,268	4
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)	218,535	259,231	17,407	20,670
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(マンデート方式)	4,356	4,971	115	157
	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%)	9,375	-	750	-
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	3,841	3,936	307	314
13	うち、内部格付標準方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付標準方式適用分	3,706	3,774	296	301
15	うち、標準的手法標準方式適用分	135	162	10	13
	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	99,580	99,580	7,966	7,966
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	99,580	99,580	7,966	7,966
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	23,245	23,147	1,971	1,962
	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	2,547,821	2,548,823	213,754	213,722

(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。