

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	3,738,802	3,833,312	316,471	324,502
2	うち、標準的手法適用分	38,596	34,817	3,087	2,785
3	うち、内部格付手法適用分	3,558,045	3,655,303	302,011	310,261
	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	1,284	1,268	102	101
	その他	140,876	141,923	11,270	11,353
4	カウンターパーティー信用リスク	50,564	52,883	4,170	4,357
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	19,615	19,777	1,663	1,677
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	24,176	26,163	1,934	2,093
	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	6,488	6,640	550	563
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	146,806	54,973	12,449	4,661
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)	315,486	349,351	25,140	27,853
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)	41,549	24,602	2,928	1,568
	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%)	12,213	25,654	977	2,052
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	25,161	25,841	2,012	2,067
13	うち、内部格付標準方式又は内部評価方式適用分	19,061	19,619	1,524	1,569
14	うち、外部格付標準方式適用分	5,736	5,829	458	466
15	うち、標準的手法標準方式適用分	260	162	20	13
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	102	230	8	18
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	194,401	194,401	15,552	15,552
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	194,401	194,401	15,552	15,552
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	66,399	66,063	5,630	5,602
	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	4,591,385	4,627,085	385,332	388,217

(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。