

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		2021年9月末	2021年6月末	2021年9月末	2021年6月末
1	信用リスク	2,082,759	2,012,312	176,386	170,362
2	うち、標準的手法適用分	9,410	16,915	752	1,353
3	うち、内部格付手法適用分	2,020,096	1,936,636	171,373	164,308
	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	53,252	58,761	4,260	4,700
4	カウンターパーティー信用リスク	80,364	79,067	6,710	6,605
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	16,811	16,499	1,425	1,399
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	21,472	20,456	1,717	1,636
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	296	282	23	22
	その他	41,784	41,828	3,543	3,547
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	53,456	97,507	4,533	8,268
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(リスク・スルー方式)	228,247	218,535	18,166	17,407
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)	5,109	4,356	105	115
	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%)	10,272	9,375	753	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	3,207	3,841	256	307
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	3,072	3,706	245	296
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	135	135	10	10
	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	100,604	99,580	8,048	7,966
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損益配分手法適用分	100,604	99,580	8,048	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	29,952	23,245	2,539	1,971
	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	2,593,975	2,547,821	217,501	213,754

(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。