

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)

OVI: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	3,854,802	3,738,802	326,344	316,471
2	うち、標準的手法適用分	34,157	38,596	2,732	3,087
3	うち、内部格付手法適用分	3,708,830	3,558,045	314,666	302,011
	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	1,252	1,284	100	102
	その他	110,562	140,876	8,844	11,270
4	カウンターパーティー信用リスク	51,818	50,564	4,271	4,170
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	20,258	19,615	1,717	1,663
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	25,273	24,176	2,021	1,934
	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	5,990	6,488	507	550
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	108,998	146,806	9,243	12,449
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)	326,058	315,486	25,966	25,140
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(マニフェット方式)	50,474	41,549	3,623	2,928
	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%)	16,835	12,213	1,189	977
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	23,395	25,161	1,871	2,012
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	18,659	19,061	1,492	1,524
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,387	5,736	351	458
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	245	260	19	20
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	102	102	8	8
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	195,252	194,401	15,620	15,552
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損益配分手法適用分	195,252	194,401	15,620	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	53,633	66,399	4,548	5,630
	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	4,681,268	4,591,385	392,679	385,332

(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。