

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		2021年12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	2,127,669	2,082,759	180,164	176,386
2	うち、標準的手法適用分	16,002	9,410	1,280	752
3	うち、内部格付手法適用分	2,058,376	2,020,096	174,621	171,373
	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	53,290	53,252	4,263	4,260
4	カウンターパーティー信用リスク	68,323	80,364	5,679	6,710
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	18,653	16,811	1,581	1,425
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	23,479	21,472	1,878	1,717
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	296	296	23	23
	その他	25,893	41,784	2,195	3,543
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	97,180	53,456	8,240	4,533
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)	313,050	228,247	25,039	18,166
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)	33,547	5,109	2,683	105
	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	-	753
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	3,098	3,207	247	256
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	2,963	3,072	237	245
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	100,604	8,048	8,048
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損利益配分手法適用分	100,604	100,604	8,048	8,048
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	14	29,952	1	2,539
	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	2,743,489	2,593,875	230,106	217,501

(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。