

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)

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12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	3,942,723	3,854,802	333,749	326,344
2	うち、標準的手法適用分	45,319	34,157	3,625	2,732
3	うち、内部格付手法適用分	3,785,399	3,708,830	321,163	314,666
	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	1,270	1,252	101	100
	その他	110,734	110,562	8,858	8,844
4	カウンターパーティー信用リスク	55,185	51,818	4,551	4,271
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	21,820	20,258	1,850	1,717
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	26,361	25,273	2,108	2,021
	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	6,706	5,990	568	507
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	173,705	108,998	14,730	9,243
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)	417,387	326,058	33,390	25,966
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(マニデート方式)	69,176	50,474	5,534	3,623
	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	-	1,189
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	22,851	23,395	1,828	1,871
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	18,236	18,659	1,458	1,492
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,266	4,387	341	351
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	245	245	19	19
	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	195,252	15,620	15,620
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、損利益配分手法適用分	195,252	195,252	15,620	15,620
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	9,235	53,633	783	4,548
	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	4,885,519	4,681,268	410,187	392,679

(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。