

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第二号第一面)

(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		2022年3月末	2021年12月末	2022年3月末	2021年12月末
1	信用リスク	2,116,360	2,127,669	179,219	180,164
2	うち、標準的手法適用分	15,307	16,002	1,224	1,280
3	うち、内部格付手法適用分	2,049,316	2,058,376	173,855	174,621
	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	51,736	53,290	4,138	4,263
4	カウンターパーティー信用リスク	85,068	68,323	7,065	5,679
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	22,845	18,653	1,937	1,581
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	30,493	23,479	2,439	1,878
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	345	296	27	23
	その他	31,382	25,893	2,661	2,195
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	58,062	97,180	4,923	8,240
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)	238,129	313,050	19,042	25,039
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)	32,736	33,547	2,618	2,683
	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%)	-	-	-	-
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	3,284	3,098	282	247
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	2,985	2,963	238	237
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	299	135	23	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	103,908	100,604	8,312	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	103,908	100,604	8,312	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	11	14	0	1
	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	2,637,562	2,743,489	221,447	230,106

(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。