

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)

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		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	3,888,379	3,942,723	324,614	333,749
2	うち、標準的手法適用分	45,008	45,319	3,600	3,625
3	うち、内部格付手法適用分	3,735,428	3,785,399	312,378	321,163
	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値のエクスポージャー	1,250	1,270	100	101
	その他	106,691	110,734	8,535	8,858
4	カウンターパーティー信用リスク	76,341	55,185	6,302	4,551
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	26,874	21,820	2,278	1,850
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	35,412	26,361	2,833	2,108
	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	13,708	6,708	1,162	568
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	126,299	173,705	10,710	14,730
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)	306,461	417,387	24,516	33,390
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)	67,534	69,176	5,402	5,534
	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	22,740	22,851	1,819	1,828
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	18,063	18,236	1,445	1,458
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,273	4,266	341	341
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	299	245	23	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	201,191	195,252	16,095	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	201,191	195,252	16,095	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	12,559	9,235	1,065	783
	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	56,801	-	4,544	-
25	合計	4,758,309	4,885,519	395,069	410,187

(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。