

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		2022年6月末	2022年3月末	2022年6月末	2022年3月末
1	信用リスク	2,137,210	2,116,360	180,984	179,219
2	うち、標準的手法適用分	16,757	15,307	1,340	1,224
3	うち、内部格付手法適用分	2,067,710	2,049,316	175,424	173,855
	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	52,742	51,736	4,219	4,138
4	カウンターパーティー信用リスク	91,459	85,068	7,553	7,065
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	27,547	22,845	2,335	1,937
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	41,714	30,493	3,337	2,439
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	385	345	30	27
	その他	21,812	31,382	1,849	2,661
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	65,491	58,062	5,553	4,923
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)	196,287	238,129	15,693	19,042
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)	41,372	32,736	3,309	2,618
	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	3,119	3,284	249	262
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	2,833	2,985	226	238
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	285	299	22	23
	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	103,908	8,312	8,312
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	103,908	8,312	8,312
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	4,139	11	351	0
	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	2,642,986	2,637,562	222,008	221,447

(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。