

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	3,918,746	3,888,379	325,294	324,614
2	うち、標準的手法適用分	57,943	45,008	4,635	3,600
3	うち、内部格付手法適用分	3,773,315	3,735,428	313,659	312,378
	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	1,181	1,250	94	100
	その他	86,306	106,691	6,904	8,535
4	カウンターパーティー信用リスク	105,597	76,341	8,698	6,302
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	36,036	26,874	3,055	2,278
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	52,995	35,412	4,239	2,833
	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	16,180	13,708	1,372	1,162
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	138,229	126,299	11,721	10,710
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)	257,583	306,461	20,606	24,516
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)	71,771	67,534	5,741	5,402
	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	22,447	22,740	1,795	1,819
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	17,941	18,063	1,435	1,445
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,118	4,273	329	341
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	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	201,191	16,095	16,095
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	201,191	16,095	16,095
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	28,113	12,559	2,383	1,065
	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	81,326	56,801	6,506	4,544
25	合計	4,825,007	4,758,309	398,843	395,069

(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。