

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第四号第一面)

(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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	2,179,348	2,137,210	184,591	180,984
2	うち、標準的手法適用分	9,646	16,757	771	1,340
3	うち、内部格付手法適用分	2,113,587	2,067,710	179,330	175,424
	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	56,114	52,742	4,489	4,219
4	カウンターパーティー信用リスク	112,371	91,459	9,301	7,553
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	32,066	27,547	2,719	2,335
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	46,953	41,714	3,756	3,337
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	377	385	30	30
	その他	32,973	21,812	2,796	1,849
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	72,584	65,491	6,155	5,553
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)	229,674	196,287	18,364	15,693
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)	47,672	41,372	3,813	3,309
	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	2,971	3,119	237	249
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	2,687	2,833	215	226
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	283	285	22	22
	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	107,968	103,908	8,637	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	107,968	103,908	8,637	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	11,417	4,139	988	351
	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	2,764,008	2,642,986	232,070	222,008

(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。