

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)

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9月末	2022年6月末	2022年9月末	2022年6月末
1	信用リスク	4,025,129	3,918,746	340,767	325,294
2	うち、標準的手法適用分	44,078	57,943	3,526	4,635
3	うち、内部格付手法適用分	3,863,638	3,773,315	327,848	313,659
	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	1,198	1,181	95	94
	その他	116,213	86,306	9,297	6,904
4	カウンターパーティー信用リスク	120,281	105,597	9,907	8,698
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	42,050	36,036	3,585	3,055
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	60,490	52,995	4,839	4,239
	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	17,362	16,180	1,472	1,372
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	128,152	138,229	10,867	11,721
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)	300,969	257,583	24,077	20,606
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)	72,279	71,771	5,782	5,741
	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	21,835	22,447	1,746	1,795
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	17,500	17,941	1,400	1,435
14	うち、外部格付準拠方式適用分	3,949	4,118	315	329
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	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	207,035	201,191	16,562	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	207,035	201,191	16,562	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	39,137	28,113	3,318	2,383
	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	-	6,506
25	合計	4,914,820	4,825,007	413,030	398,843

(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。