

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12月末	2022年9月末	2022年12月末	2022年9月末
1	信用リスク	2,154,898	2,179,348	182,513	184,591
2	うち、標準的手法適用分	10,755	9,646	860	771
3	うち、内部格付手法適用分	2,086,294	2,113,587	177,025	179,330
	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	57,849	56,114	4,627	4,489
4	カウンターパーティー信用リスク	88,861	112,371	7,307	9,301
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	36,817	32,066	3,122	2,719
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	47,110	46,953	3,768	3,756
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	474	377	37	30
	その他	4,459	32,973	378	2,796
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	96,395	72,584	8,174	6,155
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)	205,307	229,674	16,424	18,364
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)	45,853	47,672	3,668	3,813
	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	3,532	2,971	282	237
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	3,383	2,687	270	215
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	149	283	11	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	107,968	8,637	8,637
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	107,968	8,637	8,637
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	15,539	11,417	1,317	968
	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	2,718,358	2,764,008	228,325	232,070

(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。