

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	4,002,294	4,025,129	338,810	340,767
2	うち、標準的手法適用分	48,406	44,078	3,872	3,526
3	うち、内部格付手法適用分	3,831,976	3,863,638	325,185	327,848
	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	1,182	1,198	94	95
	その他	120,729	116,213	9,658	9,297
4	カウンターパーティー信用リスク	119,553	120,281	9,839	9,907
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	48,025	42,050	4,072	3,565
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	61,768	60,490	4,941	4,839
	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	9,285	17,362	787	1,472
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	181,482	128,152	15,389	10,867
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)	282,833	300,969	22,626	24,077
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(マニフェット方式)	69,238	72,279	5,539	5,782
	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	21,886	21,835	1,750	1,746
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	17,003	17,500	1,360	1,400
14	うち、外部格付準拠方式適用分	4,632	3,949	370	315
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	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	207,035	16,562	16,562
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	207,035	16,562	16,562
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	50,467	39,137	4,279	3,318
	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	4,934,792	4,914,820	414,799	413,030

(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。