

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第二号第一面)

(単位:百万円)

OVI:リスク・アセットの概要		リスク・アセット		所定自己資本	
国際様式の該当番号		2023年3月末	2022年12月末	2023年3月末	2022年12月末
1	信用リスク	2,000,687		160,055	
2	うち、標準的手法適用分	9,973		797	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,769,270		141,541	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	167,119		13,369	
5	うち、先進的内部格付手法適用分	-		-	
	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	54,323		4,345	
6	カウンターパーティー信用リスク	27,036		2,162	
7	うち、SA-CCR適用分	19,466		1,557	
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	584		46	
9	その他	6,984		558	
10	CVAリスク	36,162		2,893	
	うち、SA-CVA適用分	-		-	
	うち、完全なBA-CVA適用分	-		-	
	うち、限定的なBA-CVA適用分	36,162		2,893	
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	83,344		6,667	
12	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(ルック・スルー方式)	181,886		14,550	
13	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(マンドート方式)	25,020		2,001	
	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%)	-		-	
14	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%)	-		-	
15	未決済取引	-		-	
16	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	5,819		465	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-		-	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	5,211		416	
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	608		48	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
20	マーケット・リスク	-		-	
21	うち、標準的方式適用分	-		-	
22	うち、内部モデル方式適用分	-		-	
	うち、簡易的方式適用分	-		-	
23	勘定間の振替分	-		-	
24	オペレーショナル・リスク	67,114		5,369	
25	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	5,580		446	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	2,432,652		194,612	

(注)2023年3月末より改正後の自己資本比率告示の規定により自己資本比率の算出を行っているため、2022年12月末の当該計数については記載を省略しております。