

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)

OV1:リスク・アセットの概要		リスク・アセット		所掌自己資本	
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	3,676,970		294,157	
2	うち、標準的手法適用分	43,858		3,508	
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,320,033		265,602	
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	198,340		15,867	
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	1,181		94	
	その他	113,556		9,084	
6	カウンターパーティー信用リスク	33,757		2,700	
7	うち、SA-CCR適用分	20,890		1,671	
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	12,282		982	
10	CVAリスク	46,088		3,687	
	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	46,088		3,687	
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	164,849		13,187	
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)	263,702		21,096	
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)	36,690		2,935	
	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	23,603		1,888	
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	16,445		1,315	
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,448		515	
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	102		8	
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	138,138		11,051	
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	35,290		2,823	
26	フロア調整	-		-	
27	合計	4,419,091		353,527	

(注)2023年3月末より改正後の持株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。