

リスク・アセットの概要

(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		2025年3月末	2024年12月末	2025年3月末	2024年12月末
1	信用リスク	3,741,610	3,729,730	299,328	298,378
2	うち、標準的手法適用分	184,189	171,526	14,735	13,722
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,228,457	3,235,887	258,276	258,870
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	256,206	248,850	20,496	19,908
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	1,480	1,389	118	111
	その他	71,276	72,076	5,702	5,766
6	カウンターパーティー信用リスク	32,224	38,009	2,577	3,040
7	うち、SA-CCR適用分	23,249	21,487	1,859	1,718
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	676	613	54	49
9	その他	8,297	15,908	663	1,272
10	CVAリスク	43,282	39,049	3,462	3,123
	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	43,282	39,049	3,462	3,123
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	578,143	601,322	46,251	48,105
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)	411,640	419,175	32,931	33,534
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)	32,786	32,661	2,622	2,612
	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	23,344	21,511	1,867	1,720
17	うち、内部格付準拠方式適用分	14,808	14,582	1,184	1,166
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	8,435	6,828	674	546
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	100	100	8	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	144,328	151,757	11,546	12,140
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	51,074	31,397	4,085	2,511
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,058,436	5,064,615	404,674	405,169