

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					
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2025年9月末	2025年6月末	2025年9月末	2025年6月末
1	信用リスク	1,963,421	1,944,616	157,073	155,569
2	うち、標準的手法適用分	110,737	100,155	8,858	8,012
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,598,545	1,585,406	127,883	126,832
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	213,445	216,539	17,075	17,323
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	40,692	42,515	3,255	3,401
6	カウンターパーティー信用リスク	22,192	24,247	1,775	1,939
7	うち、SA-CCR適用分	15,682	17,149	1,254	1,371
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	509	505	40	40
9	その他	6,000	6,592	480	527
10	CVAリスク	31,883	34,482	2,550	2,758
	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	31,883	34,482	2,550	2,758
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	390,740	385,844	31,259	30,867
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)	273,877	281,502	21,910	22,520
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)	22,829	23,269	1,826	1,861
	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	6,367	5,462	509	436
17	うち、内部格付準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	6,367	5,462	509	436
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	-	-	-	-
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	75,106	72,698	6,008	5,815
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	173	2,239	13	179
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,786,591	2,774,362	222,927	221,949