

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	3,617,404	3,583,353	289,392	286,668
2	うち、標準的手法適用分	194,637	172,143	15,570	13,771
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,093,852	3,078,455	247,508	246,276
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	246,757	250,771	19,740	20,061
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値のエクスポージャー	1,519	1,482	121	118
	その他	80,637	80,500	6,451	6,440
6	カウンターパーティー信用リスク	31,228	34,618	2,498	2,769
7	うち、SA-CGR適用分	22,229	24,623	1,778	1,969
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	898	833	71	66
9	その他	8,100	9,162	648	732
10	CVAリスク	41,944	43,735	3,355	3,498
	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	41,944	43,735	3,355	3,498
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	615,408	586,186	49,232	46,894
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)	416,069	413,430	33,285	33,074
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)	27,396	28,496	2,191	2,279
	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	24,148	22,095	1,931	1,767
17	うち、内部格付準拠方式適用分	14,257	14,609	1,140	1,168
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	9,891	7,385	791	590
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	-	99	-	7
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	145,693	144,328	11,655	11,546
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	18,748	38,536	1,499	3,082
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	4,938,043	4,894,781	395,043	391,582