

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12月末	2025年9月末	2025年12月末	2025年9月末
1	信用リスク	1,994,165	1,963,421	159,533	157,073
2	うち、標準的手法適用分	125,562	110,737	10,045	8,858
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,611,919	1,598,545	128,953	127,883
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	216,026	213,445	17,282	17,075
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	40,657	40,692	3,252	3,255
6	カウンターパーティ信用リスク	20,466	22,192	1,637	1,775
7	うち、SA-CR適用分	14,223	15,682	1,137	1,254
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	507	509	40	40
9	その他	5,734	6,000	458	480
10	CVAリスク	33,173	31,883	2,653	2,550
	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	33,173	31,883	2,653	2,550
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	445,495	390,740	35,639	31,259
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)	251,703	273,877	20,136	21,910
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(マંデート方式)	22,236	22,829	1,778	1,826
	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	7,411	6,367	592	509
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	7,411	6,367	592	509
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	75,106	6,008	6,008
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	199	173	15	13
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,849,959	2,786,591	227,996	222,927