

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	3,662,783	3,617,404	293,022	289,392
2	うち、標準的手法適用分	222,741	194,637	17,819	15,570
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,108,113	3,093,852	248,649	247,508
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	249,652	246,757	19,972	19,740
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エクスポージャー	1,540	1,519	123	121
	その他	80,737	80,637	6,458	6,451
6	カウンターパーティー信用リスク	28,763	31,228	2,301	2,498
7	うち、SA-CCR適用分	19,817	22,229	1,585	1,778
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	981	898	78	71
9	その他	7,964	8,100	637	648
10	CVAリスク	41,737	41,944	3,338	3,355
	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	41,737	41,944	3,338	3,355
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	679,564	615,408	54,365	49,232
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)	392,985	416,069	31,438	33,285
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)	26,452	27,396	2,116	2,191
	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	25,270	24,148	2,021	1,931
17	うち、内部格付準拠方式適用分	14,092	14,257	1,127	1,140
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	11,178	9,891	894	791
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	145,693	145,693	11,655	11,655
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	3,373	18,748	269	1,499
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,006,626	4,938,043	400,530	395,043