

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	
		2026年6月末	2026年3月末	2026年6月末	2026年3月末
1	信用リスク	3,659,628	3,675,633	292,770	294,050
2	うち、標準的手法適用分	263,508	250,174	21,080	20,013
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	3,072,563	3,099,952	245,805	247,996
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	238,781	241,843	19,102	19,347
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	1,558	1,493	124	119
	その他	83,215	82,168	6,657	6,573
6	カウンターパーティー信用リスク	25,173	29,711	2,013	2,376
7	うち、SA-CCR適用分	18,274	21,601	1,461	1,728
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	652	802	52	64
9	その他	6,246	7,307	499	584
10	CVAリスク	33,586	42,746	2,686	3,419
	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	33,586	42,746	2,686	3,419
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	691,149	573,119	55,291	45,849
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)	504,509	454,718	40,360	36,377
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)	24,438	23,277	1,955	1,862
	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	27,924	25,406	2,233	2,032
17	うち、内部格付準拠方式適用分	13,393	13,873	1,071	1,109
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	14,531	11,528	1,162	922
19	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	4	-	0
	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	165,267	165,267	13,221	13,221
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	13,391	269	1,071
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	5,135,051	5,003,270	410,804	400,261