

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		リスク・アセット		所要自己資本	
国際様式の 該当番号		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	1,976,866	1,997,976	158,149	159,838
2	うち、標準的手法適用分	141,242	144,943	11,299	11,595
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,593,777	1,607,871	127,502	128,629
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	199,891	203,727	15,991	16,298
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	41,955	41,433	3,356	3,314
6	カウンターパーティー信用リスク	18,438	22,446	1,475	1,795
7	うち、SA-CCR適用分	13,757	16,891	1,100	1,351
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	313	304	25	24
9	その他	4,367	5,250	349	420
10	CVAリスク	30,184	38,417	2,414	3,073
	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	30,184	38,417	2,414	3,073
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	480,213	378,085	38,417	30,246
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(レック・スルー方式)	356,284	323,100	28,502	25,848
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)	21,180	20,091	1,694	1,607
	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	7,634	6,919	610	553
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	7,634	6,914	610	553
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	83,341	83,341	6,667	6,667
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	38	30	3	2
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,974,180	2,870,408	237,934	229,632