

連結リスク・アセットの概要
(2025年12月末)

(別紙様式第八号 第一面)

(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 | | イ | ロ | ハ | ニ |
| | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 当四半期末 (2025年12月末) | 前四半期末 (2025年9月末) | 当四半期末 (2025年12月末) | 前四半期末 (2025年9月末) |
| 1 | 信用リスク | 3,371,312 | 3,557,732 | 269,704 | 284,618 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 664,696 | 880,719 | 53,175 | 70,457 |
| 3 | うち、基礎的内部格付手法適用分 | 2,479,688 | 2,458,894 | 198,375 | 196,711 |
| 4 | うち、スロッシング・クラテリア適用分 | 162,222 | 153,343 | 12,977 | 12,267 |
| 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 | 64,705 | 64,773 | 5,176 | 5,181 |
| 6 | カウンターパーティ信用リスク | 25,842 | 25,765 | 2,067 | 2,061 |
| 7 | うち、S A - C C R 適用分 | 11,073 | 13,582 | 885 | 1,086 |
| 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 | 114 | 88 | 9 | 7 |
| 9 | その他 | 14,654 | 12,093 | 1,172 | 967 |
| 10 | CVA リスク | 23,412 | 29,913 | 1,873 | 2,393 |
| | うち、S A - 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 | 23,412 | 29,913 | 1,873 | 2,393 |
| 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 | - | - | - | - |
| 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) | 86,527 | 79,462 | 6,922 | 6,356 |
| 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) | 96,787 | 85,974 | 7,742 | 6,877 |
| | 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 | 3,518 | 4,254 | 281 | 340 |
| 17 | うち、内部格付手法準拠方式適用分 | - | - | - | - |
| 18 | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分 | 3,518 | 4,254 | 281 | 340 |
| 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 | 146,310 | 146,310 | 11,704 | 11,704 |
| 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 | 32,142 | 34,755 | 2,571 | 2,780 |
| 26 | フロア調整 | - | - | - | - |
| 27 | 合計 | 3,785,852 | 3,964,167 | 302,868 | 317,133 |