

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2025年12月末・連結)

(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	
		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	12,333,881	11,721,949	986,710	937,755
2	うち、標準的手法適用分	5,481,029	5,063,113	438,482	405,049
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	4,727,660	4,533,651	378,212	362,692
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	202,372	222,161	16,189	17,772
5	うち、先進的内部格付手法適用分	1,755,216	1,744,362	140,417	139,548
	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	167,602	158,660	13,408	12,692
6	カウンターパーティ信用リスク	192,549	208,297	15,403	16,663
7	うち、SA-CCR適用分	74,600	101,101	5,968	8,088
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	61,882	60,338	4,950	4,827
9	その他	56,067	46,857	4,485	3,748
10	CVAリスク	97,798	132,842	7,823	10,627
	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	97,798	132,842	7,823	10,627
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(ルック・スルー方式)	7,078,080	6,361,618	566,246	508,929
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)	275,469	237,189	22,037	18,975
	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%)	160,353	100,723	12,828	8,057
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%)	179,571	199,653	14,365	15,972
15	未決済取引	566	-	45	-
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	2,974,281	2,847,390	237,942	227,791
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	2,974,281	2,847,390	237,942	227,791
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	0	0	0	0
20	マーケット・リスク	3,928,520	3,764,395	314,281	301,151
21	うち、標準的方式適用分	3,928,520	3,764,395	314,281	301,151
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	2,203,383	2,203,383	176,270	176,270
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	107,295	147,072	8,583	11,765
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	29,531,752	27,924,516	2,362,540	2,233,961

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2025年12月末・連結)

(単位:百万円)

CR8:内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	6,500,175	
2	当四半期中 の要因別の 変動額	資産の規模	189,370
3		ポートフォリオの質	△ 138,984
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	134,688
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	6,685,249	

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2025年12月末・連結)

(単位:百万円)

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセットの額			
		内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額	標準的な手法適用分のリスク・アセットの額	リスク・アセットの額	資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額(フロア掛目前)
1	信用リスク	6,685,249	5,481,029	12,166,278	19,661,091
2	カウンターパーティ信用リスク	130,667	61,882	192,549	317,214
3	CVAリスク		97,798	97,798	97,798
4	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		2,974,281	2,974,281	2,974,281
5	マーケット・リスク		3,928,520	3,928,520	3,928,520
6	オペレーショナル・リスク		2,203,383	2,203,383	2,203,383
7	その他リスク・アセット		7,968,939	7,968,939	9,305,081
8	合計	6,815,916	22,715,835	29,531,752	38,487,371