

リスク・アセットの概要 (2019年6月末)

【連結】

(単位:百万円)

OV1: リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	4,995,485	4,982,184	422,832	421,687
2	うち、標準的手法適用分	55,695	58,490	4,455	4,679
3	うち、内部格付手法適用分	4,832,033	4,815,205	409,756	408,329
	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	6,100	6,060	488	484
	その他	101,656	102,427	8,132	8,194
4	カウンターパーティ信用リスク	56,707	57,330	4,630	4,679
5	うち、SA-CCR適用分	19,073	18,804	1,617	1,594
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,755	37,632	2,940	3,010
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	418	380	33	30
	その他	461	512	39	43
7	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	164,618	157,336	13,959	13,342
8	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)	565,260	553,584	47,779	46,741
9	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)	50,173	37,640	4,013	3,011
	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%)	-	-	-	-
10	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%)	1,895	2,370	151	189
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	1,457	1,565	116	125
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,285	1,369	102	109
14	うち、外部格付準拠方式適用分	171	196	13	15
15	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	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	89,550	72,804	7,164	5,824
17	うち、標準的方式適用分	89,550	72,804	7,164	5,824
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	294,918	294,918	23,593	23,593
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	294,918	294,918	23,593	23,593
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	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	28,296	27,618	2,399	2,342
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	1,117,975	1,068,566	89,438	85,485
25	合計	7,366,339	7,255,921	616,078	607,021

(注) 1. 「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。

【単体】

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年6月末	2019年3月末	2019年6月末	2019年3月末
1	信用リスク	4,991,998	4,974,852	422,734	421,276
2	うち、標準的手法適用分	21,179	21,272	1,694	1,701
3	うち、内部格付手法適用分	4,869,712	4,851,719	412,951	411,425
	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	101,106	101,861	8,088	8,148
4	カウンターパーティ信用リスク	56,707	57,330	4,630	4,679
5	うち、SA-CCR適用分	19,072	18,804	1,617	1,594
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	36,755	37,632	2,940	3,010
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	418	380	33	30
	その他	461	512	39	43
7	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	125,402	112,247	10,634	9,518
8	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)	565,260	553,584	47,779	46,741
9	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 (マデット方式)	50,173	37,640	4,013	3,011
	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%)	-	-	-	-
10	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%)	1,895	2,370	151	189
11	未決済取引	-	-	-	-
12	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	1,457	1,565	116	125
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,285	1,369	102	109
14	うち、外部格付準拠方式適用分	171	196	13	15
15	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	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	88,664	71,912	7,093	5,752
17	うち、標準的方式適用分	88,664	71,912	7,093	5,752
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	276,083	276,083	22,086	22,086
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	276,083	276,083	22,086	22,086
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	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	10,904	10,550	924	894
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	921,184	883,921	73,694	70,713
25	合計	7,089,733	6,982,061	593,859	584,989

(注) 1. 「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会より2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂に係る最終規則文書」における開示様式に記載された項目番号です。

2. 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。