

リスク・アセットの概要（2019年9月末・確定値）

【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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	4,911,117	4,995,485	415,658	422,832
2	うち、標準的手法適用分	59,816	55,695	4,785	4,455
3	うち、内部格付手法適用分	4,743,644	4,832,033	402,261	409,756
	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	6,118	6,100	489	488
	その他	101,537	101,656	8,123	8,132
4	カウンターパーティ信用リスク	54,675	56,707	4,464	4,630
5	うち、SA-CCR適用分	18,328	19,073	1,554	1,617
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	35,501	36,755	2,840	2,940
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	424	418	33	33
	その他	421	461	35	39
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	191,977	164,618	16,279	13,959
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)	587,245	565,260	49,643	47,779
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)	51,018	50,173	4,081	4,013
	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%)	1,690	1,895	135	151
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	1,416	1,457	113	116
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,263	1,285	101	102
14	うち、外部格付準拠方式適用分	152	171	12	13
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	72,294	89,550	5,783	7,164
17	うち、標準的方式適用分	72,294	89,550	5,783	7,164
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	296,131	294,918	23,690	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	296,131	294,918	23,690	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	28,479	28,296	2,415	2,399
	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	1,200,951	1,117,975	96,076	89,438
25	合計	7,396,997	7,366,339	618,341	616,078

(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。

【単体】

(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	
		2019年9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	4,899,066	4,991,998	414,859	422,734
2	うち、標準的手法適用分	20,118	21,179	1,609	1,694
3	うち、内部格付手法適用分	4,777,939	4,869,712	405,169	412,951
	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	101,008	101,106	8,080	8,088
4	カウンターパーティ信用リスク	54,675	56,707	4,464	4,630
5	うち、SA-CCR適用分	18,328	19,072	1,554	1,617
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	35,500	36,755	2,840	2,940
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	424	418	33	33
	その他	421	461	35	39
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	149,549	125,402	12,681	10,634
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)	587,245	565,260	49,643	47,779
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)	51,018	50,173	4,081	4,013
	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%)	1,690	1,895	135	151
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	1,416	1,457	113	116
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,263	1,285	101	102
14	うち、外部格付準拠方式適用分	152	171	12	13
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	71,461	88,664	5,716	7,093
17	うち、標準的方式適用分	71,461	88,664	5,716	7,093
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	277,674	276,083	22,213	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	277,674	276,083	22,213	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	10,568	10,904	896	924
	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	999,749	921,184	79,979	73,694
25	合計	7,104,116	7,089,733	594,786	593,859

(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ン・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・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。