

リスク・アセットの概要 (2019年12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	4,985,259	4,911,117	421,898	415,658
2	うち、標準的手法適用分	69,590	59,816	5,567	4,785
3	うち、内部格付手法適用分	4,807,762	4,743,644	407,698	402,261
	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	6,250	6,118	500	489
	その他	101,654	101,537	8,132	8,123
4	カウンターパーティ信用リスク	53,346	54,675	4,352	4,464
5	うち、SA-CCR適用分	17,130	18,328	1,452	1,554
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	35,221	35,501	2,817	2,840
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	473	424	37	33
	その他	521	421	44	35
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	201,137	191,977	17,056	16,279
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)	630,471	587,245	53,362	49,643
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)	76,261	51,018	6,100	4,081
	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%)	2,108	1,690	168	135
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	1,272	1,416	101	113
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,176	1,263	94	101
14	うち、外部格付準拠方式適用分	95	152	7	12
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	85,516	72,294	6,841	5,783
17	うち、標準的方式適用分	85,516	72,294	6,841	5,783
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	296,131	23,690	23,690
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	296,131	23,690	23,690
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	29,647	28,479	2,514	2,415
	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	1,097,666	1,200,951	87,813	96,076
25	合計	7,458,821	7,396,997	623,900	618,341

(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・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・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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	4,971,347	4,899,066	420,951	414,859
2	うち、標準的手法適用分	27,857	20,118	2,228	1,609
3	うち、内部格付手法適用分	4,842,347	4,777,939	410,631	405,169
	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	101,143	101,008	8,091	8,080
4	カウンターパーティ信用リスク	53,342	54,675	4,352	4,464
5	うち、SA-CCR適用分	17,130	18,328	1,452	1,554
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	35,221	35,500	2,817	2,840
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	469	424	37	33
	その他	521	421	44	35
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	149,340	149,549	12,664	12,681
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)	630,471	587,245	53,362	49,643
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 (マナドート方式)	76,261	51,018	6,100	4,081
	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%)	2,108	1,690	168	135
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	1,272	1,416	101	113
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,176	1,263	94	101
14	うち、外部格付準拠方式適用分	95	152	7	12
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	84,988	71,461	6,799	5,716
17	うち、標準的方式適用分	84,988	71,461	6,799	5,716
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	277,674	22,213	22,213
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	277,674	22,213	22,213
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	11,477	10,568	973	896
	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	902,522	999,749	72,201	79,979
25	合計	7,160,807	7,104,116	599,889	594,786

(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。