

リスク・アセットの概要（2020年3月末・速報値）

【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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	4,980,415	4,985,259	421,507	421,898
2	うち、標準的手法適用分	55,112	69,590	4,408	5,567
3	うち、内部格付手法適用分	4,807,231	4,807,762	407,653	407,698
	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	6,646	6,250	531	500
	その他	111,425	101,654	8,914	8,132
4	カウンターパーティ信用リスク	51,411	53,346	4,198	4,352
5	うち、SA-CCR適用分	16,158	17,130	1,370	1,452
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	33,050	35,221	2,644	2,817
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	491	473	39	37
	その他	1,711	521	145	44
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	179,312	201,137	15,205	17,056
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)	611,796	630,471	51,622	53,362
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)	32,627	76,261	2,610	6,100
	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%)	2,428	2,108	194	168
11	未決済取引	3	-	0	-
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	1,277	1,272	102	101
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,196	1,176	95	94
14	うち、外部格付準拠方式適用分	80	95	6	7
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	144,468	85,516	11,557	6,841
17	うち、標準的方式適用分	144,468	85,516	11,557	6,841
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	297,229	296,131	23,778	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	297,229	296,131	23,778	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	29,871	29,647	2,533	2,514
	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	1,039,162	1,097,666	83,132	87,813
25	合計	7,370,004	7,458,821	616,443	623,900

(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			
		2020年3月末		2019年12月末		2020年3月末		2019年12月末	
1	信用リスク	4,973,472		4,971,347		421,123		420,951	
2	うち、標準的手法適用分	19,556		27,857		1,564		2,228	
3	うち、内部格付手法適用分	4,842,854		4,842,347		410,674		410,631	
	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	111,061		101,143		8,884		8,091	
4	カウンターパーティ信用リスク	51,411		53,342		4,198		4,352	
5	うち、SA-CCR適用分	16,158		17,130		1,370		1,452	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-		-		-	
	うち、CVAリスク	33,050		35,221		2,644		2,817	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	491		469		39		37	
	その他	1,711		521		145		44	
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	125,925		149,340		10,678		12,664	
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)	611,796		630,471		51,622		53,362	
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)	32,627		76,261		2,610		6,100	
	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%)	2,428		2,108		194		168	
11	未決済取引	3		-		0		-	
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	1,277		1,272		102		101	
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,196		1,176		95		94	
14	うち、外部格付準拠方式適用分	80		95		6		7	
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	141,305		84,988		11,304		6,799	
17	うち、標準的方式適用分	141,305		84,988		11,304		6,799	
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	278,741		277,674		22,299		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	278,741		277,674		22,299		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	11,343		11,477		961		973	
	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	814,380		902,522		65,150		72,201	
25	合計	7,044,712		7,160,807		590,245		599,889	

(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。