

リスク・アセットの概要（2020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	
		2020年6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	5,006,588	4,980,415	423,711	421,507
2	うち、標準的手法適用分	57,695	55,112	4,615	4,408
3	うち、内部格付手法適用分	4,830,121	4,807,231	409,594	407,653
	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	6,745	6,646	539	531
	その他	112,025	111,425	8,962	8,914
4	カウンターパーティ信用リスク	48,240	51,411	3,937	4,198
5	うち、SA-CCR適用分	15,019	16,158	1,273	1,370
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	31,389	33,050	2,511	2,644
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	482	491	38	39
	その他	1,350	1,711	114	145
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	192,546	179,312	16,327	15,205
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)	666,137	611,796	56,284	51,622
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)	32,606	32,627	2,608	2,610
	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%)	2,425	2,428	194	194
11	未決済取引	3	3	0	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	1,201	1,277	96	102
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,133	1,196	90	95
14	うち、外部格付準拠方式適用分	68	80	5	6
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	129,794	144,468	10,383	11,557
17	うち、標準的方式適用分	129,794	144,468	10,383	11,557
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	297,229	23,778	23,778
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	297,229	23,778	23,778
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	30,499	29,871	2,586	2,533
	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	1,095,747	1,039,162	87,659	83,132
25	合計	7,503,022	7,370,004	627,569	616,443

(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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	4,999,921	4,973,472	423,356	421,123
2	うち、標準的手法適用分	21,253	19,556	1,700	1,564
3	うち、内部格付手法適用分	4,867,153	4,842,854	412,734	410,674
	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	111,513	111,061	8,921	8,884
4	カウンターパーティ信用リスク	48,240	51,411	3,937	4,198
5	うち、SA-CCR適用分	15,019	16,158	1,273	1,370
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	31,389	33,050	2,511	2,644
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	482	491	38	39
	その他	1,350	1,711	114	145
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	129,987	125,925	11,022	10,678
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)	666,137	611,796	56,284	51,622
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)	32,606	32,627	2,608	2,610
	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%)	2,425	2,428	194	194
11	未決済取引	3	3	0	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	1,201	1,277	96	102
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,133	1,196	90	95
14	うち、外部格付準拠方式適用分	68	80	5	6
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	127,896	141,305	10,231	11,304
17	うち、標準的方式適用分	127,896	141,305	10,231	11,304
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	278,741	22,299	22,299
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	278,741	22,299	22,299
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	11,418	11,343	968	961
	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	877,737	814,380	70,218	65,150
25	合計	7,176,318	7,044,712	601,218	590,245

(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。