

リスク・アセットの概要（2020年9月末・速報値）

【連結】

（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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	4,833,153	5,006,588	409,004	423,711
2	うち、標準的手法適用分	57,613	57,695	4,609	4,615
3	うち、内部格付手法適用分	4,656,762	4,830,121	394,893	409,594
	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	7,000	6,745	560	539
	その他	111,777	112,025	8,942	8,962
4	カウンターパーティ信用リスク	77,430	48,240	6,307	3,937
5	うち、SA-CCR適用分	23,041	15,019	1,953	1,273
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	53,359	31,389	4,268	2,511
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	457	482	36	38
	その他	571	1,350	48	114
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	203,366	192,546	17,245	16,327
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)	760,216	666,137	64,342	56,284
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)	54,738	32,606	4,379	2,608
	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%)	2,410	2,425	192	194
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	1,118	1,201	89	96
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,057	1,133	84	90
14	うち、外部格付準拠方式適用分	60	68	4	5
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	134,870	129,794	10,789	10,383
17	うち、標準的方式適用分	134,870	129,794	10,789	10,383
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	297,869	297,229	23,829	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	297,869	297,229	23,829	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	30,611	30,499	2,595	2,586
	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	1,215,709	1,095,747	97,256	87,659
25	合計	7,611,494	7,503,022	636,033	627,569

(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。

【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9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	4,794,815	4,999,921	405,967	423,356
2	うち、標準的手法適用分	20,495	21,253	1,639	1,700
3	うち、内部格付手法適用分	4,663,041	4,867,153	395,425	412,734
	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	111,278	111,513	8,902	8,921
4	カウンターパーティ信用リスク	77,430	48,240	6,307	3,937
5	うち、SA-CCR適用分	23,041	15,019	1,953	1,273
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	53,359	31,389	4,268	2,511
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	457	482	36	38
	その他	571	1,350	48	114
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	135,537	129,987	11,493	11,022
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)	760,216	666,137	64,342	56,284
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 (マニフェスト方式)	54,738	32,606	4,379	2,608
	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%)	2,410	2,425	192	194
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	1,118	1,201	89	96
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,057	1,133	84	90
14	うち、外部格付準拠方式適用分	60	68	4	5
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	133,920	127,896	10,713	10,231
17	うち、標準的方式適用分	133,920	127,896	10,713	10,231
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	279,696	278,741	22,375	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	279,696	278,741	22,375	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	11,493	11,418	974	968
	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	1,025,681	877,737	82,054	70,218
25	合計	7,277,058	7,176,318	608,891	601,218

(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。