

## リスク・アセットの概要（2020年12月末）

【連結】

（単位：百万円）

OVI: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12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	4,882,364	4,833,153	413,075	409,004
2	うち、標準的手法適用分	67,740	57,613	5,419	4,609
3	うち、内部格付手法適用分	4,684,686	4,656,762	397,261	394,893
	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	7,126	7,000	570	560
	その他	122,810	111,777	9,824	8,942
4	カウンターパーティ信用リスク	137,925	77,430	11,225	6,307
5	うち、SA-CCR適用分	39,294	23,041	3,332	1,953
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	97,627	53,359	7,810	4,268
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	389	457	31	36
	その他	614	571	52	48
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	246,718	203,366	20,921	17,245
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)	782,102	760,216	66,197	64,342
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)	78,148	54,738	6,251	4,379
	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%)	2,072	2,410	165	192
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	1,045	1,118	83	89
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	989	1,057	79	84
14	うち、外部格付準拠方式適用分	56	60	4	4
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	130,259	134,870	10,420	10,789
17	うち、標準的方式適用分	130,259	134,870	10,420	10,789
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	297,869	23,829	23,829
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	297,869	23,829	23,829
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	31,124	30,611	2,639	2,595
	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	1,107,501	1,215,709	88,600	97,256
25	合計	7,697,133	7,611,494	643,412	636,033

(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	
		2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク	4,836,023	4,794,815	409,392	405,967
2	うち、標準的手法適用分	24,039	20,495	1,923	1,639
3	うち、内部格付手法適用分	4,689,666	4,663,041	397,683	395,425
	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	122,317	111,278	9,785	8,902
4	カウンターパーティ信用リスク	137,925	77,430	11,225	6,307
5	うち、SA-CCR適用分	39,294	23,041	3,332	1,953
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	97,627	53,359	7,810	4,268
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	389	457	31	36
	その他	614	571	52	48
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	179,112	135,537	15,188	11,493
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)	782,102	760,216	66,197	64,342
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)	78,148	54,738	6,251	4,379
	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%)	2,072	2,410	165	192
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	1,045	1,118	83	89
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	989	1,057	79	84
14	うち、外部格付準拠方式適用分	56	60	4	4
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	129,323	133,920	10,345	10,713
17	うち、標準的方式適用分	129,323	133,920	10,345	10,713
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	279,696	22,375	22,375
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	279,696	22,375	22,375
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	11,752	11,493	996	974
	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	923,896	1,025,681	73,911	82,054
25	合計	7,361,099	7,277,058	616,135	608,891

(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。