

リスク・アセットの概要（2019年9月末）

【連結】

（単位：百万円）

0V1：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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク	4,261,769	4,311,707	360,232	364,458
2	うち、標準的手法適用分	105,422	102,432	8,433	8,194
3	うち、内部格付手法適用分	4,019,015	4,067,008	340,812	344,882
	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	137,331	142,267	10,986	11,381
4	カウンターパーティ信用リスク	135,243	84,579	10,965	6,900
5	うち、S A－C C R適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	29,422	27,116	2,495	2,299
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、C V Aリスク	104,797	56,605	8,383	4,528
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	68	76	5	6
	その他	956	781	81	66
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	128,694	127,174	10,913	10,784
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）	458,816	430,575	36,705	34,446
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）	36,069	41,840	2,885	3,347
	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％）	-	3,098	-	262
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％）	-	-	-	-
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	22,527	22,822	1,802	1,825
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	22,527	22,822	1,802	1,825
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	19,705	18,782	1,576	1,502
17	うち、標準的方式適用分	19,705	18,782	1,576	1,502
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	299,862	298,063	23,989	23,845
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	299,862	298,063	23,989	23,845
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	53,785	56,059	4,561	4,753
	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	-	-	-	-
25	合計	5,416,476	5,394,705	453,631	452,126

リスク・アセットの概要（2019年9月末）

【単体】

（単位：百万円）

0V1：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9月末	2019年6月末	2019年9月末	2019年6月末
1	信用リスク		4, 266, 336	4, 331, 755	361, 149	366, 667
2		うち、標準的手法適用分	192	248	15	19
3		うち、内部格付手法適用分	4, 133, 889	4, 193, 080	350, 553	355, 573
		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	132, 254	138, 426	10, 580	11, 074
4	カウンターパーティ信用リスク		135, 212	84, 509	10, 962	6, 894
5		うち、S A－C C R適用分	－	－	－	－
		うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	29, 422	27, 116	2, 495	2, 299
6		うち、期待エクスポージャー方式適用分	－	－	－	－
		うち、C V Aリスク	104, 797	56, 605	8, 383	4, 528
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	68	76	5	6
	その他		924	711	78	60
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		376, 305	362, 051	31, 910	30, 701
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）		468, 740	441, 449	37, 499	35, 315
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）		36, 069	41, 840	2, 885	3, 347
	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％）		－	3, 098	－	262
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％）		－	－	－	－
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		22, 527	22, 822	1, 802	1, 825
13		うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	－	－	－	－
14		うち、外部格付準拠方式適用分	22, 527	22, 822	1, 802	1, 825
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		19, 475	18, 594	1, 558	1, 487
17		うち、標準的方式適用分	19, 475	18, 594	1, 558	1, 487
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		258, 156	257, 039	20, 652	20, 563
20		うち、基礎的手法適用分	－	－	－	－
21		うち、粗利益配分手法適用分	258, 156	257, 039	20, 652	20, 563
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		40, 916	43, 122	3, 469	3, 656
	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		－	－	－	－
25	合計		5, 623, 742	5, 606, 284	471, 890	470, 722