

リスク・アセットの概要（2019年12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	4,327,586	4,261,769	365,810	360,232
2	うち、標準的手法適用分	107,412	105,422	8,593	8,433
3	うち、内部格付手法適用分	4,084,112	4,019,015	346,332	340,812
	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	136,061	137,331	10,884	10,986
4	カウンターパーティ信用リスク	124,108	135,243	10,068	10,965
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	28,135	29,422	2,385	2,495
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	94,805	104,797	7,584	8,383
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	75	68	6	5
	その他	1,091	956	92	81
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	130,323	128,694	11,051	10,913
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）	438,022	458,816	35,041	36,705
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）	50,745	36,069	4,059	2,885
	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％）	-	-	-	-
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	24,040	22,527	1,923	1,802
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	24,040	22,527	1,923	1,802
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	21,521	19,705	1,721	1,576
17	うち、標準的方式適用分	21,521	19,705	1,721	1,576
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	299,862	23,989	23,989
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	299,862	23,989	23,989
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	53,846	53,785	4,566	4,561
	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	5,470,057	5,416,476	458,232	453,631

リスク・アセットの概要（2019年12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12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	4,337,097	4,266,336	367,118	361,149
2	うち、標準的手法適用分	177	192	14	15
3	うち、内部格付手法適用分	4,198,062	4,133,889	355,995	350,553
	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	138,856	132,254	11,108	10,580
4	カウンターパーティ信用リスク	124,100	135,212	10,068	10,962
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	28,136	29,422	2,385	2,495
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	94,805	104,797	7,584	8,383
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	75	68	6	5
	その他	1,082	924	91	78
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	377,718	376,305	32,030	31,910
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）	448,601	468,740	35,888	37,499
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）	50,745	36,069	4,059	2,885
	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％）	-	-	-	-
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	24,040	22,527	1,923	1,802
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	24,040	22,527	1,923	1,802
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	21,463	19,475	1,717	1,558
17	うち、標準的方式適用分	21,463	19,475	1,717	1,558
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	258,156	20,652	20,652
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	258,156	20,652	20,652
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	40,916	3,469	3,469
	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	5,682,841	5,623,742	476,927	471,890