

リスク・アセットの概要（2020年3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	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	4,328,660	4,327,586	365,894	365,810
2	うち、標準的手法適用分	110,668	107,412	8,853	8,593
3	うち、内部格付手法適用分	4,083,713	4,084,112	346,298	346,332
	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	134,278	136,061	10,742	10,884
4	カウンターパーティ信用リスク	107,587	124,108	8,748	10,068
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	28,018	28,135	2,375	2,385
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	78,075	94,805	6,246	7,584
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	65	75	5	6
	その他	1,427	1,091	121	92
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	145,922	130,323	12,374	11,051
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）	440,828	438,022	35,266	35,041
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）	48,440	50,745	3,875	4,059
	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	28,139	24,040	2,251	1,923
13	うち、内部格付手法準抛方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準抛方式適用分	28,139	24,040	2,251	1,923
15	うち、標準的手法準抛方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250％のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	18,560	21,521	1,484	1,721
17	うち、標準的方式適用分	18,560	21,521	1,484	1,721
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	299,781	299,862	23,982	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	299,781	299,862	23,982	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	53,018	53,846	4,495	4,566
	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	5,470,939	5,470,057	458,373	458,232

リスク・アセットの概要（2020年3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	
			2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク		4,318,520	4,337,097	365,579	367,118
2		うち、標準的手法適用分	89	177	7	14
3		うち、内部格付手法適用分	4,187,109	4,198,062	355,066	355,995
		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	131,321	138,856	10,505	11,108
4	カウンターパーティ信用リスク		107,578	124,100	8,747	10,068
5		うち、SA－CCR適用分	－	－	－	－
		うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	28,023	28,136	2,376	2,385
6		うち、期待エクスポージャー方式適用分	－	－	－	－
		うち、CVAリスク	78,076	94,805	6,246	7,584
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	65	75	5	6
	その他		1,412	1,082	119	91
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		419,025	377,718	35,533	32,030
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)		449,358	448,601	35,948	35,888
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)		48,440	50,745	3,875	4,059
	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		28,139	24,040	2,251	1,923
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	28,139	24,040	2,251	1,923
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		17,317	21,463	1,385	1,717
17		うち、標準的方式適用分	17,317	21,463	1,385	1,717
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		257,522	258,156	20,601	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	257,522	258,156	20,601	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		5,686,820	5,682,841	477,392	476,927