

リスク・アセットの概要（2020年6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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	4, 520, 532	4, 328, 660	382, 016	365, 894
2	うち、標準的手法適用分	111, 272	110, 668	8, 901	8, 853
3	うち、内部格付手法適用分	4, 244, 497	4, 083, 713	359, 933	346, 298
	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	164, 762	134, 278	13, 180	10, 742
4	カウンターパーティ信用リスク	117, 660	107, 587	9, 570	8, 748
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	31, 590	28, 018	2, 678	2, 375
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	84, 753	78, 075	6, 780	6, 246
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	59	65	4	5
	その他	1, 256	1, 427	106	121
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	149, 249	145, 922	12, 656	12, 374
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）	411, 263	440, 828	32, 901	35, 266
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, 616	48, 440	3, 889	3, 875
	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, 853	28, 139	2, 308	2, 251
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, 853	28, 139	2, 308	2, 251
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	19, 190	18, 560	1, 535	1, 484
17	うち、標準的方式適用分	19, 190	18, 560	1, 535	1, 484
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, 781	23, 982	23, 982
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, 781	23, 982	23, 982
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	56, 527	53, 018	4, 793	4, 495
	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, 651, 675	5, 470, 939	473, 652	458, 373

リスク・アセットの概要（2020年6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6月末	2020年3月末	2020年6月末	2020年3月末
1	信用リスク	4, 528, 940	4, 318, 520	383, 282	365, 579
2	うち、標準的手法適用分	108	89	8	7
3	うち、内部格付手法適用分	4, 368, 258	4, 187, 109	370, 428	355, 066
	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	160, 573	131, 321	12, 845	10, 505
4	カウンターパーティ信用リスク	117, 643	107, 578	9, 569	8, 747
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	31, 602	28, 023	2, 679	2, 376
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	84, 757	78, 076	6, 780	6, 246
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	59	65	4	5
	その他	1, 223	1, 412	103	119
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	422, 161	419, 025	35, 799	35, 533
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）	420, 495	449, 358	33, 639	35, 948
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）	51, 853	48, 440	4, 148	3, 875
	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, 853	28, 139	2, 308	2, 251
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, 853	28, 139	2, 308	2, 251
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	16, 361	17, 317	1, 308	1, 385
17	うち、標準的方式適用分	16, 361	17, 317	1, 308	1, 385
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	257, 522	20, 601	20, 601
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	257, 522	20, 601	20, 601
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, 884, 748	5, 686, 820	494, 127	477, 392