

リスク・アセットの概要（2020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	
		2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク	4,505,352	4,520,532	380,850	382,016
2	うち、標準的手法適用分	112,479	111,272	8,998	8,901
3	うち、内部格付手法適用分	4,254,597	4,244,497	360,789	359,933
	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	138,274	164,762	11,061	13,180
4	カウンターパーティ信用リスク	113,601	117,660	9,238	9,570
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	30,438	31,590	2,581	2,678
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	82,236	84,753	6,578	6,780
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	57	59	4	4
	その他	868	1,256	73	106
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	151,881	149,249	12,879	12,656
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）	324,641	411,263	25,971	32,901
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）	51,474	48,616	4,117	3,889
	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	30,200	28,853	2,416	2,308
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	30,200	28,853	2,416	2,308
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	17,324	19,190	1,385	1,535
17	うち、標準的方式適用分	17,324	19,190	1,385	1,535
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	303,686	299,781	24,294	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	303,686	299,781	24,294	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	57,358	56,527	4,863	4,793
	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	5,555,520	5,651,675	466,018	473,652

リスク・アセットの概要（2020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	
			2020年9月末	2020年6月末	2020年9月末	2020年6月末
1	信用リスク		4, 527, 442	4, 528, 940	383, 287	383, 282
2		うち、標準的手法適用分	162	108	12	8
3		うち、内部格付手法適用分	4, 394, 082	4, 368, 258	372, 618	370, 428
		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	133, 197	160, 573	10, 655	12, 845
4	カウンターパーティ信用リスク		113, 611	117, 643	9, 239	9, 569
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	30, 446	31, 602	2, 581	2, 679
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	82, 238	84, 757	6, 579	6, 780
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	57	59	4	4
		その他	868	1, 223	73	103
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		436, 477	422, 161	37, 013	35, 799
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)		334, 966	420, 495	26, 797	33, 639
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, 474	51, 853	4, 117	4, 148
	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		30, 200	28, 853	2, 416	2, 308
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	30, 200	28, 853	2, 416	2, 308
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, 920	16, 361	1, 433	1, 308
17		うち、標準的方式適用分	17, 920	16, 361	1, 433	1, 308
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		261, 426	257, 522	20, 914	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	261, 426	257, 522	20, 914	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, 814, 437	5, 884, 748	488, 688	494, 127