

リスク・アセットの概要（2020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	
			2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク		4,630,259	4,505,352	391,415	380,850
2		うち、標準的手法適用分	112,136	112,479	8,970	8,998
3		うち、内部格付手法適用分	4,373,805	4,254,597	370,898	360,789
		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	144,317	138,274	11,545	11,061
4	カウンターパーティ信用リスク		118,317	113,601	9,612	9,238
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	29,627	30,438	2,512	2,581
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	87,556	82,236	7,004	6,578
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	148	57	11	4
		その他	984	868	83	73
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		155,052	151,881	13,148	12,879
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)		350,179	324,641	28,014	25,971
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)		63,187	51,474	5,054	4,117
	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		30,990	30,200	2,479	2,416
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	30,990	30,200	2,479	2,416
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		19,691	17,324	1,575	1,385
17		うち、標準的方式適用分	19,691	17,324	1,575	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		303,686	303,686	24,294	24,294
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	303,686	24,294	24,294
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		54,625	57,358	4,632	4,863
	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		5,725,989	5,555,520	480,226	466,018

リスク・アセットの概要（2020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 の該当番号			イ	ロ	ハ	ニ
			リスク・アセット		所要自己資本	
			2020年12月末	2020年9月末	2020年12月末	2020年9月末
1	信用リスク		4,648,522	4,527,442	393,520	383,287
2		うち、標準的手法適用分	232	162	18	12
3		うち、内部格付手法適用分	4,508,057	4,394,082	382,283	372,618
		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	140,233	133,197	11,218	10,655
4	カウンターパーティ信用リスク		118,320	113,611	9,612	9,239
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	29,630	30,446	2,512	2,581
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	87,557	82,238	7,004	6,579
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	148	57	11	4
		その他	984	868	83	73
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		439,433	436,477	37,263	37,013
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)		361,019	334,966	28,881	26,797
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)		63,187	51,474	5,054	4,117
	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		30,990	30,200	2,479	2,416
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	30,990	30,200	2,479	2,416
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		19,512	17,920	1,561	1,433
17		うち、標準的方式適用分	19,512	17,920	1,561	1,433
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	261,426	20,914	20,914
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	261,426	20,914	20,914
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		37,222	40,916	3,156	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		5,979,635	5,814,437	502,444	488,688