

リスク・アセットの概要（2021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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	4,644,169	4,630,259	392,600	391,415
2	うち、標準的手法適用分	116,739	112,136	9,339	8,970
3	うち、内部格付手法適用分	4,388,970	4,373,805	372,184	370,898
	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	138,459	144,317	11,076	11,545
4	カウンターパーティ信用リスク	121,600	118,317	9,871	9,612
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	28,940	29,627	2,454	2,512
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	91,657	87,556	7,332	7,004
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	77	148	6	11
	その他	925	984	78	83
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	107,169	155,052	9,087	13,148
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）	334,235	350,179	26,738	28,014
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）	75,903	63,187	6,072	5,054
	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％）	3,648	-	309	-
	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	35,176	30,990	2,814	2,479
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	35,176	30,990	2,814	2,479
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	19,350	19,691	1,548	1,575
17	うち、標準的方式適用分	19,350	19,691	1,548	1,575
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	302,295	303,686	24,183	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	302,295	303,686	24,183	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	60,688	54,625	5,146	4,632
	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	5,704,239	5,725,989	478,372	480,226

リスク・アセットの概要（2021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	
			2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク		4, 671, 694	4, 648, 522	395, 512	393, 520
2		うち、標準的手法適用分	171	232	13	18
3		うち、内部格付手法適用分	4, 536, 944	4, 508, 057	384, 732	382, 283
		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, 579	140, 233	10, 766	11, 218
4	カウンターパーティ信用リスク		121, 609	118, 320	9, 872	9, 612
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, 947	29, 630	2, 454	2, 512
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	91, 658	87, 557	7, 332	7, 004
		うち、中央清算機関関連エクスポージャー	77	148	6	11
		その他	925	984	78	83
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		395, 996	439, 433	33, 580	37, 263
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)		343, 715	361, 019	27, 497	28, 881
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)		75, 903	63, 187	6, 072	5, 054
	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%)		3, 648	－	309	－
	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%)		2, 080	－	176	－
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		35, 176	30, 990	2, 814	2, 479
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	35, 176	30, 990	2, 814	2, 479
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		18, 822	19, 512	1, 505	1, 561
17		うち、標準的方式適用分	18, 822	19, 512	1, 505	1, 561
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		259, 532	261, 426	20, 762	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	259, 532	261, 426	20, 762	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	37, 222	3, 156	3, 156
	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, 965, 403	5, 979, 635	501, 259	502, 444