

リスク・アセットの概要 (2021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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	4,572,740	4,644,169	386,531	392,600
2	うち、標準的手法適用分	115,254	116,739	9,220	9,339
3	うち、内部格付手法適用分	4,315,146	4,388,970	365,924	372,184
	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	142,338	138,459	11,387	11,076
4	カウンターパーティ信用リスク	119,613	121,600	9,738	9,871
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	34,432	28,940	2,919	2,454
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	84,189	91,657	6,735	7,332
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	101	77	8	6
	その他	889	925	75	78
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	135,913	107,169	11,525	9,087
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)	457,324	334,235	36,585	26,738
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 (マデート方式)	61,000	75,903	4,880	6,072
	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%)	3,795	3,648	321	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	2	-	0	-
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	31,608	35,176	2,528	2,814
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	31,608	35,176	2,528	2,814
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	18,990	19,350	1,519	1,548
17	うち、標準的方式適用分	18,990	19,350	1,519	1,548
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	302,295	24,183	24,183
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	302,295	24,183	24,183
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	56,185	60,688	4,764	5,146
	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	5,759,469	5,704,239	482,580	478,372

リスク・アセットの概要（2021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	
		2021年6月末	2021年3月末	2021年6月末	2021年3月末
1	信用リスク	4,605,411	4,671,694	389,872	395,512
2	うち、標準的手法適用分	207	171	16	13
3	うち、内部格付手法適用分	4,466,641	4,536,944	378,771	384,732
	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	138,562	134,579	11,085	10,766
4	カウンターパーティ信用リスク	119,625	121,609	9,739	9,872
5	うち、SA-C-CR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	34,441	28,947	2,920	2,454
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	84,192	91,658	6,735	7,332
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	101	77	8	6
	その他	889	925	75	78
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	337,920	395,996	28,655	33,580
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）	466,791	343,715	37,343	27,497
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（マデート方式）	61,000	75,903	4,880	6,072
	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%）	3,795	3,648	321	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	2	-	0	-
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	31,608	35,176	2,528	2,814
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	31,608	35,176	2,528	2,814
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	18,453	18,822	1,476	1,505
17	うち、標準的方式適用分	18,453	18,822	1,476	1,505
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	259,532	20,762	20,762
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	259,532	20,762	20,762
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	31,499	37,222	2,671	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	5,935,642	5,965,403	498,252	501,259