

(リスク・アセットの概要)

「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月28日に公表された開示要件(第3の柱)の改訂と題する文書における表に記載された番号を指します。

【2019年3月期(連結)】

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月期	2018年12月期	2019年3月期	2018年12月期
1	信用リスク	3,213,598	3,119,181	271,878	263,863
2	うち、標準的手法適用分	10,042	9,689	803	775
3	うち、内部格付手法適用分	3,081,340	2,985,294	261,297	253,152
	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	122,215	124,195	9,777	9,935
4	カウンターパーティ信用リスク	37,348	35,591	3,085	2,951
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	10,029	8,806	850	746
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,014	13,793	1,361	1,103
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10	6	0	0
	その他	10,295	12,987	873	1,101
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	258,960	256,776	21,959	21,774
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(レックスルー方式)	180,132		15,106	
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)	—		—	
	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%)	11,189		948	
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%)	7,129		570	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		—		—
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー		223,684		18,945
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	1,500	801	120	67
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	1,500		120	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		801		67
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
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	151,592	151,642	12,127	12,131
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	151,592	151,642	12,127	12,131
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	9	9	0	0
	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	3,861,461	3,787,687	325,797	319,736

【2019年3月期（単体）】

（単位：百万円）

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月期	2018年12月期	2019年3月期	2018年12月期
1	信用リスク	3,171,514	3,075,947	268,536	260,427
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,086,523	2,989,875	261,737	253,541
	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	84,990	86,071	6,799	6,885
4	カウンターパーティ信用リスク	37,349	35,594	3,085	2,952
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	10,029	8,806	850	746
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	17,014	13,793	1,361	1,103
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	10	6	0	0
	その他	10,295	12,987	873	1,101
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	218,478	217,771	18,527	18,467
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（レックスルー方式）	189,473		15,899	
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（マンドレート方式）	—		—	
	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%）	11,154		945	
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%）	7,129		570	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー		—		—
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー		233,050		19,740
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	1,500	801	120	67
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	1,500		120	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分		801		67
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	—	—	—	—
17	うち、標準的方式適用分	—	—	—	—
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	141,227	141,383	11,298	11,310
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	141,227	141,383	11,298	11,310
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	22,586	22,586	1,915	1,915
	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	3,800,414	3,727,135	320,897	314,879