

(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。

【2018年6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	
		2018年6月期	2018年3月期	2018年6月期	2018年3月期
1	信用リスク	3,199,000	3,166,405	270,583	267,807
2	うち、標準的手法適用分	9,538	9,740	763	779
3	うち、内部格付手法適用分	3,054,884	3,019,876	259,054	256,085
	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	134,577	136,789	10,766	10,943
4	カウンターパーティ信用リスク	35,943	53,705	2,979	4,431
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	9,608	20,529	814	1,740
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	14,337	25,584	1,146	2,046
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	7	3	0	0
	その他	11,990	7,587	1,016	643
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 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	218,458	170,844	18,525	14,487
	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	229,029	253,534	19,401	21,477
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	890	1,669	75	141
13	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	890	1,669	75	141
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—
15	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	153,950	153,950	12,316	12,316
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	153,950	153,950	12,316	12,316
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	3,837,283	3,800,118	323,881	320,662

【2018年6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	
		2018年6月期	2018年3月期	2018年6月期	2018年3月期
1	信用リスク	3,156,141	3,124,660	267,177	264,492
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,059,592	3,025,022	259,453	256,521
	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	96,548	99,637	7,723	7,971
4	カウンターパーティ信用リスク	35,943	53,705	2,979	4,431
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	9,608	20,529	814	1,740
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	14,337	25,584	1,146	2,046
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	7	3	0	0
	その他	11,990	7,587	1,016	643
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 複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	177,611	121,983	15,061	10,344
	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	237,903	262,065	20,153	22,200
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	890	1,669	75	141
13	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	890	1,669	75	141
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—
15	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	143,750	143,750	11,500	11,500
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	143,750	143,750	11,500	11,500
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	3,774,828	3,730,419	318,862	315,026