

(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9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9月期	2018年6月期	2018年9月期	2018年6月期
1	信用リスク	3,167,856	3,199,000	268,005	270,583
2	うち、標準的手法適用分	9,940	9,538	795	763
3	うち、内部格付手法適用分	3,036,776	3,054,884	257,518	259,054
	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	121,139	134,577	9,691	10,766
4	カウンターパーティ信用リスク	31,722	35,943	2,627	2,979
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	8,259	9,608	700	814
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,097	14,337	1,047	1,146
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8	7	0	0
	その他	10,357	11,990	878	1,016
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	278,466	218,458	23,613	18,525
	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	245,574	229,029	20,796	19,401
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	870	890	73	75
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	870	890	73	75
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	151,642	153,950	12,131	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	151,642	153,950	12,131	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	3,876,142	3,837,283	327,248	323,881

【2018年9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9月期	2018年6月期	2018年9月期	2018年6月期
1	信用リスク	3,124,416	3,156,141	264,553	267,177
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,041,670	3,059,592	257,933	259,453
	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	82,745	96,548	6,619	7,723
4	カウンターパーティ信用リスク	31,722	35,943	2,627	2,979
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	8,259	9,608	700	814
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,098	14,337	1,047	1,146
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	8	7	0	0
	その他	10,357	11,990	878	1,016
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	226,655	177,611	19,220	15,061
	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	258,364	237,903	21,880	20,153
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	870	890	73	75
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	870	890	73	75
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	141,383	143,750	11,310	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	141,383	143,750	11,310	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	3,805,998	3,774,828	321,580	318,862