

(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12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12月期	2018年9月期	2018年12月期	2018年9月期
1	信用リスク	3,119,181	3,167,856	263,863	268,005
2	うち、標準的手法適用分	9,689	9,940	775	795
3	うち、内部格付手法適用分	2,985,294	3,036,776	253,152	257,518
	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	124,195	121,139	9,935	9,691
4	カウンターパーティ信用リスク	35,591	31,722	2,951	2,627
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	8,806	8,259	746	700
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,793	13,097	1,103	1,047
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	6	8	0	0
	その他	12,987	10,357	1,101	878
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	256,776	278,466	21,774	23,613
	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	245,574	18,945	20,796
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	801	870	67	73
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	801	870	67	73
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	151,642	12,131	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	151,642	151,642	12,131	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	3,787,687	3,876,142	319,736	327,248

【2018年12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12月期	2018年9月期	2018年12月期	2018年9月期
1	信用リスク	3,075,947	3,124,416	260,427	264,553
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,989,875	3,041,670	253,541	257,933
	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	86,071	82,745	6,885	6,619
4	カウンターパーティ信用リスク	35,594	31,722	2,952	2,627
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	8,806	8,259	746	700
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,793	13,098	1,103	1,047
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	6	8	0	0
	その他	12,987	10,357	1,101	878
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	217,771	226,655	18,467	19,220
	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	258,364	19,740	21,880
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	801	870	67	73
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	801	870	67	73
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	141,383	11,310	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	141,383	141,383	11,310	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	3,727,135	3,805,998	314,879	321,580