

(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	
		2019年6月期	2019年3月期	2019年6月期	2019年3月期
1	信用リスク	3,229,932	3,213,598	273,263	271,878
2	うち、標準的手法適用分	10,291	10,042	823	803
3	うち、内部格付手法適用分	3,097,729	3,081,340	262,687	261,297
	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	121,911	122,215	9,752	9,777
4	カウンターパーティ信用リスク	41,586	37,348	3,435	3,085
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	11,499	10,029	975	850
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,862	17,014	1,509	1,361
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	10	1	0
	その他	11,204	10,295	950	873
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	242,371	258,960	20,553	21,959
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)	186,269	180,132	15,626	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%)	10,863	11,189	921	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%)	5,036	7,129	402	570
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	1,384	1,500	110	120
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	1,384	1,500	110	120
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	—	—	—	—
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	151,592	12,127	12,127
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	151,592	12,127	12,127
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	3,869,047	3,861,461	326,442	325,797

【2019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	
		2019年6月期	2019年3月期	2019年6月期	2019年3月期
1	信用リスク	3,187,306	3,171,514	269,879	268,536
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,103,127	3,086,523	263,145	261,737
	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	84,178	84,990	6,734	6,799
4	カウンターパーティ信用リスク	41,586	37,349	3,435	3,085
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	11,499	10,029	975	850
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	18,862	17,014	1,509	1,361
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	10	1	0
	その他	11,204	10,295	950	873
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	192,030	218,478	16,284	18,527
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）	196,159	189,473	16,465	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%）	10,839	11,154	919	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%）	5,036	7,129	402	570
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	1,384	1,500	110	120
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	1,384	1,500	110	120
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	—	—	—	—
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	141,227	11,298	11,298
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	141,227	11,298	11,298
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	3,798,156	3,800,414	320,711	320,897