

(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。

【2021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	
		2021年3月期	2020年12月期	2021年3月期	2020年12月期
1	信用リスク	3,640,886	3,493,689	308,085	295,617
2	うち、標準的手法適用分	10,288	10,456	823	836
3	うち、内部格付手法適用分	3,502,947	3,358,826	297,049	284,828
	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	127,650	124,406	10,212	9,952
4	カウンターパーティ信用リスク	48,445	57,638	3,960	4,739
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	15,398	15,119	1,305	1,282
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,472	30,698	2,437	2,455
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	211	194	16	15
	その他	2,363	11,625	200	985
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	434,096	355,060	36,811	30,109
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)	161,870	149,487	13,558	12,493
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%)	8,647	8,500	733	720
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%)	276	421	22	33
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	882	924	70	73
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	882	924	70	73
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	155,604	153,999	12,448	12,319
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,604	153,999	12,448	12,319
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	4,450,719	4,219,731	375,691	356,108

【2021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	
		2021年3月期	2020年12月期	2021年3月期	2020年12月期
1	信用リスク	3,619,698	3,450,161	306,535	292,177
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,533,294	3,367,643	299,623	285,576
	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	86,404	82,518	6,912	6,601
4	カウンターパーティ信用リスク	48,445	57,638	3,960	4,739
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	15,398	15,119	1,305	1,282
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,472	30,698	2,437	2,455
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	211	194	16	15
	その他	2,363	11,625	200	985
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	377,453	273,152	32,008	23,163
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）	171,489	159,096	14,374	13,307
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%）	8,647	8,500	733	720
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%）	276	421	22	33
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	882	924	70	73
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	882	924	70	73
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	144,875	141,618	11,590	11,329
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	144,875	141,618	11,590	11,329
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	—	41,609	—	3,528
	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	4,371,770	4,133,122	369,295	349,074