

(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。

【2020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	
		2020年6月期	2020年3月期	2020年6月期	2020年3月期
1	信用リスク	3,368,321	3,298,423	284,998	279,060
2	うち、標準的手法適用分	10,637	10,864	851	869
3	うち、内部格付手法適用分	3,235,976	3,163,938	274,410	268,302
	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	121,707	123,620	9,736	9,889
4	カウンターパーティ信用リスク	45,504	51,063	3,756	4,209
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	12,228	15,085	1,036	1,279
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	21,258	25,011	1,700	2,000
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	115	87	9	7
	その他	11,902	10,878	1,009	922
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	300,789	244,941	25,506	20,771
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)	149,917	160,152	12,514	13,380
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%)	8,342	12,353	707	1,047
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%)	693	141	55	11
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	1,056	1,167	84	93
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	1,056	1,167	84	93
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	153,713	153,713	12,297	12,297
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	153,713	153,713	12,297	12,297
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	4,028,348	3,921,966	339,921	330,871

【2020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	
		2020年6月期	2020年3月期	2020年6月期	2020年3月期
1	信用リスク	3,327,061	3,256,188	281,741	275,724
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,245,080	3,172,770	275,182	269,050
	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	81,980	83,418	6,558	6,673
4	カウンターパーティ信用リスク	45,504	51,063	3,756	4,209
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	12,228	15,085	1,036	1,279
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	21,258	25,011	1,700	2,000
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	115	87	9	7
	その他	11,902	10,878	1,009	922
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	234,708	186,803	19,903	15,840
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）	159,766	170,736	13,349	14,277
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%）	8,342	12,353	707	1,047
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%）	693	141	55	11
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	1,056	1,167	84	93
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	1,056	1,167	84	93
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	143,014	143,014	11,441	11,441
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	143,014	143,014	11,441	11,441
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	3,942,734	3,844,056	332,954	324,561