

(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	
		2020年9月期	2020年6月期	2020年9月期	2020年6月期
1	信用リスク	3,422,300	3,368,321	289,578	284,998
2	うち、標準的手法適用分	10,700	10,637	856	851
3	うち、内部格付手法適用分	3,290,525	3,235,976	279,036	274,410
	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	121,074	121,707	9,685	9,736
4	カウンターパーティ信用リスク	56,222	45,504	4,625	3,756
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	14,315	12,228	1,213	1,036
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	29,423	21,258	2,353	1,700
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	146	115	11	9
	その他	12,337	11,902	1,046	1,009
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	333,087	300,789	28,245	25,506
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)	149,755	149,917	12,504	12,514
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%)	8,457	8,342	717	707
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%)	821	693	65	55
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	1,023	1,056	81	84
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	1,023	1,056	81	84
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	153,999	153,713	12,319	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	153,999	153,713	12,319	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	4,125,677	4,028,348	348,140	339,921

【2020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	
		2020年9月期	2020年6月期	2020年9月期	2020年6月期
1	信用リスク	3,378,651	3,327,061	286,126	281,741
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,298,866	3,245,080	279,743	275,182
	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	79,784	81,980	6,382	6,558
4	カウンターパーティ信用リスク	56,222	45,504	4,625	3,756
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	14,315	12,228	1,213	1,036
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	29,423	21,258	2,353	1,700
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	146	115	11	9
	その他	12,337	11,902	1,046	1,009
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	258,940	234,708	21,958	19,903
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）	159,608	159,766	13,340	13,349
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%）	8,457	8,342	717	707
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%）	821	693	65	55
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	1,023	1,056	81	84
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	1,023	1,056	81	84
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	141,618	143,014	11,329	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	141,618	143,014	11,329	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	41,609	22,586	3,528	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	4,046,953	3,942,734	341,773	332,954