

(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	
		2020年12月期	2020年9月期	2020年12月期	2020年9月期
1	信用リスク	3,493,689	3,422,300	295,617	289,578
2	うち、標準的手法適用分	10,456	10,700	836	856
3	うち、内部格付手法適用分	3,358,826	3,290,525	284,828	279,036
	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	124,406	121,074	9,952	9,685
4	カウンターパーティ信用リスク	57,638	56,222	4,739	4,625
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	15,119	14,315	1,282	1,213
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,698	29,423	2,455	2,353
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	194	146	15	11
	その他	11,625	12,337	985	1,046
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	355,060	333,087	30,109	28,245
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)	149,487	149,755	12,493	12,504
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%)	8,500	8,457	720	717
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%)	421	821	33	65
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	924	1,023	73	81
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	924	1,023	73	81
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	153,999	12,319	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	153,999	153,999	12,319	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	4,219,731	4,125,677	356,108	348,140

【2020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	
		2020年12月期	2020年9月期	2020年12月期	2020年9月期
1	信用リスク	3,450,161	3,378,651	292,177	286,126
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,367,643	3,298,866	285,576	279,743
	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	82,518	79,784	6,601	6,382
4	カウンターパーティ信用リスク	57,638	56,222	4,739	4,625
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	15,119	14,315	1,282	1,213
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,698	29,423	2,455	2,353
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	194	146	15	11
	その他	11,625	12,337	985	1,046
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	273,152	258,940	23,163	21,958
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）	159,096	159,608	13,307	13,340
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%）	8,500	8,457	720	717
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%）	421	821	33	65
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	924	1,023	73	81
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	924	1,023	73	81
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	141,618	11,329	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	141,618	141,618	11,329	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	41,609	3,528	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	4,133,122	4,046,953	349,074	341,773