

(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。

【2022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	
		2022年3月期	2021年12月期	2022年3月期	2021年12月期
1	信用リスク	3,552,402	3,574,782	300,645	302,469
2	うち、標準的手法適用分	10,279	9,735	822	778
3	うち、内部格付手法適用分	3,427,738	3,434,725	290,672	291,264
	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	114,384	130,321	9,150	10,425
4	カウンターパーティ信用リスク	89,567	73,430	7,360	5,986
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	23,989	21,755	2,034	1,844
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	48,677	49,805	3,894	3,984
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	279	265	22	21
	その他	16,620	1,603	1,409	135
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	464,718	474,691	39,408	40,253
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)	137,644	189,313	11,507	15,880
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(マンドレート方式)	—	—	—	—
	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%)	8,424	8,376	714	710
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%)	313	346	25	27
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	615	648	49	51
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	615	648	49	51
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	160,793	157,695	12,863	12,615
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	160,793	157,695	12,863	12,615
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	4,414,489	4,479,295	372,573	377,996

【2022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	
		2022年3月期	2021年12月期	2022年3月期	2021年12月期
1	信用リスク	3,529,677	3,552,077	298,951	300,774
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,453,507	3,460,150	292,857	293,420
	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	76,170	91,926	6,093	7,354
4	カウンターパーティ信用リスク	89,567	73,430	7,360	5,986
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	23,989	21,755	2,034	1,844
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	48,677	49,805	3,894	3,984
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	279	265	22	21
	その他	16,620	1,603	1,409	135
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	444,069	442,594	37,657	37,532
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）	147,709	199,371	12,360	16,733
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%）	8,424	8,376	714	710
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%）	313	346	25	27
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	615	648	49	51
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	615	648	49	51
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	149,888	145,484	11,991	11,638
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	149,888	145,484	11,991	11,638
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	—	—	—	—
	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	4,370,266	4,422,330	369,108	373,455