

(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	
		2021年6月期	2021年3月期	2021年6月期	2021年3月期
1	信用リスク	3,595,827	3,640,886	304,250	308,085
2	うち、標準的手法適用分	10,150	10,288	812	823
3	うち、内部格付手法適用分	3,454,999	3,502,947	292,983	297,049
	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	130,678	127,650	10,454	10,212
4	カウンターパーティ信用リスク	48,284	48,445	3,943	3,960
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	15,742	15,398	1,334	1,305
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	31,352	30,472	2,508	2,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	217	211	17	16
	その他	973	2,363	82	200
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	444,574	434,096	37,699	36,811
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)	169,539	161,870	14,205	13,558
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%)	8,729	8,647	740	733
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%)	2,055	276	164	22
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	766	882	61	70
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	766	882	61	70
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	155,604	12,448	12,448
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	155,604	12,448	12,448
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	4,425,390	4,450,719	373,513	375,691

【2021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	
		2021年6月期	2021年3月期	2021年6月期	2021年3月期
1	信用リスク	3,574,547	3,619,698	302,695	306,535
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,485,749	3,533,294	295,591	299,623
	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	88,798	86,404	7,103	6,912
4	カウンターパーティ信用リスク	48,284	48,445	3,943	3,960
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	15,742	15,398	1,334	1,305
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	31,352	30,472	2,508	2,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	217	211	17	16
	その他	973	2,363	82	200
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	402,669	377,453	34,146	32,008
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）	178,925	171,489	15,001	14,374
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%）	8,729	8,647	740	733
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%）	2,055	276	164	22
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	766	882	61	70
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	766	882	61	70
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	144,875	11,590	11,590
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	144,875	11,590	11,590
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	4,360,853	4,371,770	368,341	369,295