

(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	
		2021年9月期	2021年6月期	2021年9月期	2021年6月期
1	信用リスク	3,576,869	3,595,827	302,668	304,250
2	うち、標準的手法適用分	9,963	10,150	797	812
3	うち、内部格付手法適用分	3,441,352	3,454,999	291,826	292,983
	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	125,553	130,678	10,044	10,454
4	カウンターパーティ信用リスク	47,833	48,284	3,910	3,943
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	15,742	1,334	1,334
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,208	31,352	2,416	2,508
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	230	217	18	17
	その他	1,652	973	140	82
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	461,195	444,574	39,109	37,699
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)	200,220	169,539	16,792	14,205
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%)	8,433	8,729	715	740
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%)	8,519	2,055	681	164
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	738	766	59	61
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	738	766	59	61
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	157,695	155,604	12,615	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	157,695	155,604	12,615	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	4,461,515	4,425,390	376,551	373,513

【2021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	
		2021年9月期	2021年6月期	2021年9月期	2021年6月期
1	信用リスク	3,551,733	3,574,547	300,782	302,695
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,467,433	3,485,749	294,038	295,591
	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	84,299	88,798	6,743	7,103
4	カウンターパーティ信用リスク	47,833	48,284	3,910	3,943
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	15,742	1,334	1,334
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	30,208	31,352	2,416	2,508
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	230	217	18	17
	その他	1,652	973	140	82
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	423,051	402,669	35,874	34,146
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）	209,607	178,925	17,588	15,001
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%）	8,433	8,729	715	740
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%）	8,519	2,055	681	164
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	738	766	59	61
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	738	766	59	61
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	145,484	144,875	11,638	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	145,484	144,875	11,638	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	4,395,401	4,360,853	371,249	368,341