

(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	
		2021年12月期	2021年9月期	2021年12月期	2021年9月期
1	信用リスク	3,574,782	3,576,869	302,469	302,668
2	うち、標準的手法適用分	9,735	9,963	778	797
3	うち、内部格付手法適用分	3,434,725	3,441,352	291,264	291,826
	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	130,321	125,553	10,425	10,044
4	カウンターパーティ信用リスク	73,430	47,833	5,986	3,910
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	21,755	15,742	1,844	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	49,805	30,208	3,984	2,416
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	265	230	21	18
	その他	1,603	1,652	135	140
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	474,691	461,195	40,253	39,109
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)	189,313	200,220	15,880	16,792
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%)	8,376	8,433	710	715
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%)	346	8,519	27	681
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	648	738	51	59
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	648	738	51	59
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	157,695	12,615	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	157,695	157,695	12,615	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	4,479,295	4,461,515	377,996	376,551

【2021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	
		2021年12月期	2021年9月期	2021年12月期	2021年9月期
1	信用リスク	3,552,077	3,551,733	300,774	300,782
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	3,460,150	3,467,433	293,420	294,038
	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	91,926	84,299	7,354	6,743
4	カウンターパーティ信用リスク	73,430	47,833	5,986	3,910
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	21,755	15,742	1,844	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	49,805	30,208	3,984	2,416
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	265	230	21	18
	その他	1,603	1,652	135	140
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	442,594	423,051	37,532	35,874
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）	199,371	209,607	16,733	17,588
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%）	8,376	8,433	710	715
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%）	346	8,519	27	681
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	648	738	51	59
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	648	738	51	59
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	145,484	11,638	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	145,484	145,484	11,638	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	4,422,330	4,395,401	373,455	371,249