

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結：平成30年6月末】

(単位：百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		平成30年6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	2,707,325	2,720,815	229,177	230,124
2	うち、標準的手法適用分	27,171	26,352	2,173	2,108
3	うち、内部格付手法適用分	2,623,203	2,595,716	222,447	220,116
	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	56,950	98,747	4,556	7,899
4	カウンターパーティ信用リスク	55,630	58,679	4,584	4,838
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	21,908	23,615	1,857	2,002
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	25,121	26,117	2,009	2,089
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,610	2,628	208	210
	その他	5,990	6,317	507	535
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	440,489	475,213	37,353	40,298
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	9	9	0	0
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	331,374	317,953	28,100	26,962
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	16,202	13,925	1,373	1,180
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	16,202	13,925	1,373	1,180
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
	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	163,772	163,772	13,101	13,101
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	163,772	163,772	13,101	13,101
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	12,210	12,194	1,029	1,028
	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	3,727,014	3,762,565	314,721	317,535

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結：平成30年6月末】

(単位：百万円)

CR8：内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,121,342	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 3,602
3		ポートフォリオの質	△ 3,847
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,113,893	

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【単体：平成30年6月末】

(単位：百万円)

OV1:リスク・アセットの概要		イ		ロ		ハ		ニ	
国際様式 の該 当番号		リスク・アセット		所要自己資本					
		平成30年 6月末	平成30年 3月末	平成30年 6月末	平成30年 3月末				
1	信用リスク	2,692,780	2,706,404	228,095	229,049				
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-				
3	うち、内部格付手法適用分	2,640,151	2,611,935	223,884	221,492				
	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	52,628	94,469	4,210	7,557				
4	カウンターパーティ信用リスク	55,630	58,679	4,584	4,838				
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	21,908	23,615	1,857	2,002				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-				
	うち、CVAリスク	25,121	26,117	2,009	2,089				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,610	2,628	208	210				
	その他	5,990	6,317	507	535				
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	440,489	475,213	37,353	40,298				
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	-	-	-	-				
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	330,605	317,223	28,035	26,900				
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	16,202	13,925	1,373	1,180				
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	16,202	13,925	1,373	1,180				
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-				
15	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-				
	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	155,969	155,969	12,477	12,477				
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-				
21	うち、粗利益配分手法適用分	155,969	155,969	12,477	12,477				
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	10,012	10,006	849	848				
	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	3,701,691	3,737,423	312,769	315,593				