

Ⅷ. 定量的な開示事項【単体】

1. 自己資本比率（第3の柱）に関する告示別紙様式第2号により開示する事項

(1) OV1

(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3月31日	平成29年3月31日	平成30年3月31日	平成29年3月31日
1	信用リスク	2,706,404		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	2,611,935		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	94,469		7,557	
4	カウンターパーティ信用リスク	58,679		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	23,615		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	26,117		2,089	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,628		210	
	その他	6,317		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	475,213		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	317,223		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	13,925		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	13,925		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、1,250%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		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		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	10,006		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	3,737,423		315,593	

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		平成30年3月31日	平成29年3月31日	平成30年3月31日	平成29年3月31日
1	上方パラレルシフト	39,760		3,421	
2	下方パラレルシフト	—		△270	
3	スティープ化	12,159			
4	フラット化	3,219			
5	短期金利上昇	19,171			
6	短期金利低下	—			
7	最大値	39,760		3,421	
		ホ		ハ	
		平成30年3月31日		平成29年3月31日	
8	Tier1資本の額	507,832			