

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3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3月末	平成29年12月末	平成30年3月末	平成29年12月末
1	信用リスク	2,720,815		230,124	
2	うち、標準的手法適用分	26,352		2,108	
3	うち、内部格付手法適用分	2,595,716		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	98,747		7,899	
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	9		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	317,953		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	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、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		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		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	12,194		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	3,762,565		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3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	3,139,464	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	15,390
3		ポートフォリオの質	△ 33,511
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	3,121,342	

(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3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 3月末	平成29年 12月末	平成30年 3月末	平成29年 12月末				
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、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				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			