

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9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9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	2,746,453	2,707,325	232,460	229,177
2	うち、標準的手法適用分	28,172	27,171	2,253	2,173
3	うち、内部格付手法適用分	2,655,139	2,623,203	225,155	222,447
	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	63,141	56,950	5,051	4,556
4	カウンターパーティ信用リスク	57,775	55,630	4,770	4,584
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	21,508	21,908	1,823	1,857
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	24,456	25,121	1,956	2,009
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,418	2,610	193	208
	その他	9,392	5,990	796	507
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	426,968	440,489	36,206	37,353
	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	369,229	331,374	31,310	28,100
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	17,776	16,202	1,507	1,373
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	17,776	16,202	1,507	1,373
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	161,272	163,772	12,901	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	161,272	163,772	12,901	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	12,491	12,210	1,053	1,029
	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	3,791,977	3,727,014	320,212	314,721

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9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	3,113,893	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 20,004
3		ポートフォリオの質	38,472
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	3,132,360	

(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9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 9月末	平成30年 6月末	平成30年 9月末	平成30年 6月末
1	信用リスク	2,732,016	2,692,780	231,393	228,095
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,673,345	2,640,151	226,699	223,884
	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	58,671	52,628	4,693	4,210
4	カウンターパーティ信用リスク	57,775	55,630	4,770	4,584
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	21,508	21,908	1,823	1,857
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	24,456	25,121	1,956	2,009
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	2,418	2,610	193	208
	その他	9,392	5,990	796	507
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	426,968	440,489	36,206	37,353
	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	368,401	330,605	31,240	28,035
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	17,776	16,202	1,507	1,373
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	17,776	16,202	1,507	1,373
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	153,372	155,969	12,269	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	153,372	155,969	12,269	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	10,201	10,012	865	849
	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	3,766,512	3,701,691	318,253	312,769