

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		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					
		2019年9月30日	2018年9月30日	2019年9月30日	2018年9月30日				
1	信用リスク	2,659,369	2,732,016	225,302	231,393				
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—				
3	うち、内部格付手法適用分	2,615,215	2,673,345	221,770	226,699				
	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	44,154	58,671	3,532	4,693				
4	カウンターパーティ信用リスク	71,228	57,775	5,878	4,770				
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	22,230	21,508	1,885	1,823				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	28,771	24,456	2,301	1,956				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,014	2,418	401	193				
	その他	15,212	9,392	1,290	796				
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	464,206	426,968	39,364	36,206				
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)	284,001		24,083					
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 (マデデート方式)	—		—					
	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%)	—		—					
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1.250%)	—		—					
	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	—	31,240				
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	101,743	17,776	8,139	1,507				
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	101,743	—	8,139	—				
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—				
	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	—	1,507				
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—				
	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	148,419	153,372	11,873	12,269				
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—				
21	うち、粗利益配分手法適用分	148,419	153,372	11,873	12,269				
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	10,508	10,201	891	865				
	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	3,739,478	3,766,512	315,532	318,253				

(注記事項)

1. 上記計表は2019年3月末基準より新告示が適用されているため新告示の改正事項を反映し、作成しております。

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2019年9月30日	2018年9月30日	2019年9月30日	2018年9月30日
1	上方平行シフト	30,564	34,381	△5,401	△3,269
2	下方平行シフト	—	—	5,575	5,573
3	スティープ化	16,097	12,830		
4	フラット化	5,357	4,345		
5	短期金利上昇	12,700	15,659		
6	短期金利低下	4,888	6,460		
7	最大値	30,564	34,381	5,575	5,573
		ホ		ハ	
		2019年9月30日		2018年9月30日	
8	Tier1資本の額	522,650		515,945	