

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		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3月31日	2018年3月31日	2019年3月31日	2018年3月31日
1	信用リスク	2,716,022	2,706,404	230,099	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	2,670,395	2,611,935	226,449	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	45,626	94,469	3,650	7,557
4	カウンターパーティ信用リスク	68,835	58,679	5,672	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	22,449	23,615	1,903	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	30,469	26,117	2,437	2,089
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	3,848	2,628	307	210
	その他	12,068	6,317	1,023	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	422,069	475,213	35,791	40,298
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)	353,945		30,014	
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 (マドレー方式)	—		—	
	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%)	24,371		1,949	
	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	105,491	13,925	8,439	1,180
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	105,491		8,439	
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		13,925		1,180
	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	150,477	155,969	12,038	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	150,477	155,969	12,038	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	10,258	10,006	869	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	3,851,472	3,737,423	324,875	315,593

(注記事項)

1. 上記計表は当期末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3月31日	2018年3月31日	2019年3月31日	2018年3月31日
1	上方平行シフト	23,947	39,760	△4,191	3,421
2	下方平行シフト	2,427	—	5,450	△270
3	スティープ化	15,645	12,159		
4	フラット化	8,716	3,219		
5	短期金利上昇	12,624	19,171		
6	短期金利低下	6,718	—		
7	最大値	23,947	39,760	5,450	3,421
		ホ		ハ	
		2019年3月31日		2018年3月31日	
8	Tier1資本の額	510,444		507,832	