

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		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年3月31日	2019年3月31日	2020年3月31日	2019年3月31日
		イ	ロ	ハ	ニ
1	信用リスク	2,672,121	2,716,022	226,391	230,099
2	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
3	うち、内部格付手法適用分	2,629,556	2,670,395	222,986	226,449
	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	42,565	45,626	3,405	3,650
4	カウンターパーティ信用リスク	59,746	68,835	4,909	5,672
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	22,308	22,449	1,891	1,903
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	27,398	30,469	2,191	2,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,411	3,848	432	307
	その他	4,628	12,068	392	1,023
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	373,525	422,069	31,674	35,791
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)	248,520	353,945	21,074	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 (マンドート方式)	—	—	—	—
	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%)	—	24,371	—	1,949
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	105,341	105,491	8,427	8,439
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	105,341	105,491	8,427	8,439
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	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	146,058	150,477	11,684	12,038
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,058	150,477	11,684	12,038
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	15,796	10,258	1,339	869
	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	3,621,111	3,851,472	305,501	324,875

(2) IRRBB1

(単位：百万円)

IRRBB1：金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2020年3月31日	2019年3月31日	2020年3月31日	2019年3月31日
1	上方平行シフト	18,118	23,947	△6,606	△4,191
2	下方平行シフト	9,500	2,427	7,631	5,450
3	スティープ化	11,693	15,645		
4	フラット化	12,371	8,716		
5	短期金利上昇	9,776	12,624		
6	短期金利低下	5,910	6,718		
7	最大値	18,118	23,947	7,631	5,450
		ホ		ハ	
		2020年3月31日		2019年3月31日	
8	Tier1資本の額	484,994		510,444	