

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：2018年12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					
		2018年12月	2018年9月	2018年12月	2018年9月				
		月末	月末	月末	月末				
1	信用リスク	2,764,691	2,746,453	234,006	232,460				
2	うち、標準的手法適用分	29,512	28,172	2,360	2,253				
3	うち、内部格付手法適用分	2,673,270	2,655,139	226,693	225,155				
	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	61,908	63,141	4,952	5,051				
4	カウンターパーティ信用リスク	55,197	57,775	4,554	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	20,301	21,508	1,721	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	23,306	24,456	1,864	1,956				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	3,020	2,418	241	193				
	その他	8,568	9,392	726	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	376,378	426,968	31,916	36,206				
	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	335,331	369,229	28,436	31,310				
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	18,072	17,776	1,532	1,507				
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	18,072	17,776	1,532	1,507				
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	161,272	12,901	12,901				
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	161,272	12,901	12,901				
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	12,727	12,491	1,072	1,053				
	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	3,723,680	3,791,977	314,422	320,212				

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：2018年12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	3,132,360	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 22,206
3		ポートフォリオの質	△ 10,277
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	3,099,876	

(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：2018年12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	
		2018年12 月末	2018年9 月末	2018年12 月末	2018年9 月末
1	信用リスク	2,749,674	2,732,016	232,900	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	2,693,068	2,673,345	228,372	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	56,606	58,671	4,528	4,693
4	カウンターパーティ信用リスク	55,197	57,775	4,554	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	20,301	21,508	1,721	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	23,306	24,456	1,864	1,956
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	3,020	2,418	241	193
	その他	8,568	9,392	726	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	376,378	426,968	31,916	36,206
	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	334,651	368,401	28,378	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	18,072	17,776	1,532	1,507
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	18,072	17,776	1,532	1,507
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	153,372	12,269	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	153,372	153,372	12,269	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	10,216	10,201	866	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	3,697,562	3,766,512	312,419	318,253