

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:2019年3月末](別紙様式第八号第一面)

(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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	2,731,426	2,764,691	231,235	234,006
2	うち、標準的手法適用分	30,362	29,512	2,429	2,360
3	うち、内部格付手法適用分	2,650,223	2,673,270	224,738	226,693
	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	50,840	61,908	4,067	4,952
4	カウンターパーティ信用リスク	68,835	55,197	5,672	4,554
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	20,301	1,903	1,721
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	23,306	2,437	1,864
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	3,848	3,020	307	241
	その他	12,068	8,568	1,023	726
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	376,378	35,791	31,916
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)	354,667		30,075	
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1250%)	24,496		1,959	
	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		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		28,436
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	18,072	8,439	1,532
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		18,072		1,532
	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、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	158,638	161,272	12,691	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	158,638	161,272	12,691	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	12,720	12,727	1,072	1,072
	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	3,878,345	3,723,680	326,937	314,422

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：2019年3月末】（別紙様式第八号第二面）（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	3,099,876	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 39,824
3		ポートフォリオの質	62,398
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	3,122,450	

（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：2019年3月末】(別紙様式第八号第一面)

(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月末	2018年 12月末	2019年 3月末	2018年 12月末				
1	信用リスク	2,716,022	2,749,674	230,099	232,900				
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	2,693,068	226,449	228,372				
	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	56,606	3,650	4,528				
4	カウンターパーティ信用リスク	68,835	55,197	5,672	4,554				
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	20,301	1,903	1,721				
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	23,306	2,437	1,864				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	3,848	3,020	307	241				
	その他	12,068	8,568	1,023	726				
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	376,378	35,791	31,916				
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1250%)	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		334,651		28,378				
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	18,072	8,439	1,532				
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		18,072		1,532				
	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、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	150,477	153,372	12,038	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	150,477	153,372	12,038	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	10,258	10,216	869	866				
	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	3,697,562	324,875	312,419				