

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6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 6月末	2019年 3月末	2019年 6月末	2019年 3月末				
1	信用リスク	2,682,611	2,731,426	227,094	231,235				
2	うち、標準的手法適用分	30,825	30,362	2,466	2,429				
3	うち、内部格付手法適用分	2,601,167	2,650,223	220,578	224,738				
	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	50,619	50,840	4,049	4,067				
4	カウンターパーティ信用リスク	71,387	68,835	5,881	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	24,287	22,449	2,059	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	31,658	30,469	2,532	2,437				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,153	3,848	332	307				
	その他	11,288	12,068	957	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	463,401	422,069	39,296	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)	250,872	354,667	21,273	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				
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	98,806	105,491	7,904	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	98,806	105,491	7,904	8,439				
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-				
	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	158,638	12,691	12,691				
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	158,638	12,691	12,691				
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	12,994	12,720	1,095	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	3,738,712	3,878,345	315,237	326,937				

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6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	3,122,450	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	16,144
3		ポートフォリオの質	△ 23,758
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	3,114,836	

(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6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 6月末	2019年 3月末	2019年 6月末	2019年 3月末
1	信用リスク	2,667,801	2,716,022	226,012	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	2,622,554	2,670,395	222,392	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	45,246	45,626	3,619	3,650
4	カウンターパーティ信用リスク	71,387	68,835	5,881	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	24,287	22,449	2,059	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	31,658	30,469	2,532	2,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,153	3,848	332	307
	その他	11,288	12,068	957	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	463,361	422,069	39,293	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)	250,146	353,945	21,212	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
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	98,806	105,491	7,904	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	98,806	105,491	7,904	8,439
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	150,477	12,038	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	150,477	150,477	12,038	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	10,569	10,258	896	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	3,712,550	3,851,472	313,238	324,875