

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9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 9月末	2019年 6月末	2019年 9月末	2019年 6月末				
1	信用リスク	2,667,617	2,682,611	225,818	227,094				
2	うち、標準的手法適用分	32,240	30,825	2,579	2,466				
3	うち、内部格付手法適用分	2,585,258	2,601,167	219,229	220,578				
	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	50,118	50,619	4,009	4,049				
4	カウンターパーティ信用リスク	71,228	71,387	5,878	5,881				
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	22,230	24,287	1,885	2,059				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-				
	うち、CVAリスク	28,771	31,658	2,301	2,532				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,014	4,153	401	332				
	その他	15,212	11,288	1,290	957				
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	464,246	463,401	39,368	39,296				
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)	285,064	250,872	24,171	21,273				
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%)	-	-	-	-				
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	101,743	98,806	8,139	7,904				
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	101,743	98,806	8,139	7,904				
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	156,811	158,638	12,544	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	156,811	158,638	12,544	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	12,810	12,994	1,080	1,095				
	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	3,759,523	3,738,712	317,001	315,237				

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9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	3,114,836	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 3,554
3		ポートフォリオの質	△ 11,790
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	3,099,491	

(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9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 9月末	2019年 6月末	2019年 9月末	2019年 6月末
1	信用リスク	2,659,369	2,667,801	225,302	226,012
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,615,215	2,622,554	221,770	222,392
	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	44,154	45,246	3,532	3,619
4	カウンターパーティ信用リスク	71,228	71,387	5,878	5,881
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	22,230	24,287	1,885	2,059
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	28,771	31,658	2,301	2,532
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,014	4,153	401	332
	その他	15,212	11,288	1,290	957
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	464,206	463,361	39,364	39,293
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)	284,001	250,146	24,083	21,212
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%)	-	-	-	-
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	101,743	98,806	8,139	7,904
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	101,743	98,806	8,139	7,904
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	148,419	150,477	11,873	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	148,419	150,477	11,873	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	10,508	10,569	891	896
	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	3,739,478	3,712,550	315,532	313,238