

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:2020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					
		2020年 3月末	2019年 12月末	2020年 3月末	2019年 12月末				
1	信用リスク	2,682,173	2,714,647	227,049	229,788				
2	うち、標準的手法適用分	34,018	32,622	2,721	2,609				
3	うち、内部格付手法適用分	2,599,156	2,628,418	220,408	222,889				
	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	48,998	53,606	3,919	4,288				
4	カウンターパーティ信用リスク	59,746	76,505	4,909	6,331				
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	21,744	1,891	1,843				
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	28,179	2,191	2,254				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,411	4,285	432	342				
	その他	4,628	22,296	392	1,890				
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	373,565	461,904	31,678	39,169				
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)	249,613	269,009	21,165	22,810				
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	105,341	106,384	8,427	8,510				
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	106,384	8,427	8,510				
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	154,773	156,811	12,381	12,544				
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-				
21	うち、粗利益配分手法適用分	154,773	156,811	12,381	12,544				
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	26,882	12,666	2,273	1,068				
	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	3,652,096	3,797,928	307,885	320,224				

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：2020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	3,139,646	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	△ 175,389
3		ポートフォリオの質	71,992
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	3,036,249	

(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：2020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	
		2020年 3月末	2019年 12月末	2020年 3月末	2019年 12月末
1	信用リスク	2,672,121	2,705,384	226,391	229,192
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	2,658,728	222,986	225,460
	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	46,656	3,405	3,732
4	カウンターパーティ信用リスク	59,746	76,505	4,909	6,331
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	21,744	1,891	1,843
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	28,179	2,191	2,254
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	5,411	4,285	432	342
	その他	4,628	22,296	392	1,890
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	461,864	31,674	39,166
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	267,976	21,074	22,724
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	105,341	106,384	8,427	8,510
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	106,384	8,427	8,510
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	146,058	148,419	11,684	11,873
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	148,419	11,684	11,873
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	10,510	1,339	891
	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	3,777,045	305,501	318,690