

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12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 12月末	2019年 9月末	2019年 12月末	2019年 9月末
1	信用リスク	2,714,647	2,667,617	229,788	225,818
2	うち、標準的手法適用分	32,622	32,240	2,609	2,579
3	うち、内部格付手法適用分	2,628,418	2,585,258	222,889	219,229
	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	53,606	50,118	4,288	4,009
4	カウンターパーティ信用リスク	76,505	71,228	6,331	5,878
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	21,744	22,230	1,843	1,885
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	28,179	28,771	2,254	2,301
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,285	5,014	342	401
	その他	22,296	15,212	1,890	1,290
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	461,904	464,246	39,169	39,368
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)	269,009	285,064	22,810	24,171
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	106,384	101,743	8,510	8,139
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	106,384	101,743	8,510	8,139
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	156,811	12,544	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	156,811	156,811	12,544	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	12,666	12,810	1,068	1,080
	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	3,797,928	3,759,523	320,224	317,001

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12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	3,099,491	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	86,188
3		ポートフォリオの質	△ 46,033
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	3,139,646	

(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12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 12月末	2019年 9月末	2019年 12月末	2019年 9月末
1	信用リスク	2,705,384	2,659,369	229,192	225,302
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,658,728	2,615,215	225,460	221,770
	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	46,656	44,154	3,732	3,532
4	カウンターパーティ信用リスク	76,505	71,228	6,331	5,878
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	21,744	22,230	1,843	1,885
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	28,179	28,771	2,254	2,301
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	4,285	5,014	342	401
	その他	22,296	15,212	1,890	1,290
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	461,864	464,206	39,166	39,364
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)	267,976	284,001	22,724	24,083
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	106,384	101,743	8,510	8,139
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	106,384	101,743	8,510	8,139
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	148,419	11,873	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	148,419	148,419	11,873	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	10,510	10,508	891	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	3,777,045	3,739,478	318,690	315,532