

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項(2018年9月期自己資本比率)

(平成26年金融庁告示第7号、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 (連結)		イ		ロ		ハ		ニ	
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本					
		当四半期末 (2018年9月期)	前四半期末 (2018年6月期)	当四半期末 (2018年9月期)	前四半期末 (2018年6月期)	当四半期末 (2018年9月期)	前四半期末 (2018年6月期)		
1	信用リスク	2,203,717	2,210,872	186,624	187,227				
2	うち、標準的手法適用分	5,633	5,721	450	457				
3	うち、内部格付手法適用分	2,151,527	2,157,807	182,449	182,982				
	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	3,522	3,486	281	278				
	その他	43,033	43,857	3,442	3,508				
4	カウンターパーティ信用リスク	51,662	58,702	4,319	4,910				
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	4,761	5,073	403	430				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	11,996	13,347	959	1,067				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	875	716	70	57				
	その他	34,029	39,565	2,885	3,355				
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	269,072	281,634	22,817	23,882				
	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	628,433	567,210	53,291	48,099				
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	30,385	30,581	2,576	2,593				
13	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	5,251	5,418	445	459				
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—				
15	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	25,133	25,163	2,131	2,133				
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	181,555	184,730	14,524	14,778				
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—				
21	うち、粗利益配分手法適用分	181,555	184,730	14,524	14,778				
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	20,010	19,928	1,696	1,689				
	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	3,384,836	3,353,660	285,850	283,181				

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により平成27年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

(平成26年金融庁告示第7号、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 (単体)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の 該当番号 (注)		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 (2018年9月期)	前四半期末 (2018年6月期)	当四半期末 (2018年9月期)	前四半期末 (2018年6月期)
1	信用リスク	2,140,629	2,164,369	181,362	183,372
2	うち、標準的手法適用分	2,003	2,105	160	168
3	うち、内部格付手法適用分	2,106,786	2,129,810	178,655	180,607
	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	31,839	32,454	2,547	2,596
4	カウンターパーティ信用リスク	51,665	58,708	4,319	4,910
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	4,762	5,077	403	430
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	11,997	13,349	959	1,067
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	875	716	70	57
	その他	34,029	39,565	2,885	3,355
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	298,427	310,918	25,306	26,365
	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	628,052	566,859	53,258	48,069
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	30,385	30,581	2,576	2,593
13	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	5,251	5,418	445	459
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	—	—	—	—
15	うち、標準的手法適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	25,133	25,163	2,131	2,133
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	153,716	157,137	12,297	12,570
20	うち、基礎的手法適用分	—	—	—	—
21	うち、粗利益配分手法適用分	153,716	157,137	12,297	12,570
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	19,819	19,727	1,680	1,672
	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	3,322,697	3,308,301	280,802	279,556

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により平成27年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。