

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6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6月期)	前四半期末 (2018年3月期)	当四半期末 (2018年6月期)	前四半期末 (2018年3月期)	当四半期末 (2018年6月期)	前四半期末 (2018年3月期)		
1	信用リスク	2,210,872	2,171,108	187,227	183,869				
2	うち、標準的手法適用分	5,721	5,451	457	436				
3	うち、内部格付手法適用分	2,157,807	2,120,941	182,982	179,855				
	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	3,486	3,476	278	278				
	その他	43,857	41,239	3,508	3,299				
4	カウンターパーティ信用リスク	58,702	62,876	4,910	5,261				
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	5,073	5,342	430	453				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	13,347	13,927	1,067	1,114				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	716	695	57	55				
	その他	39,565	42,911	3,355	3,638				
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	281,634	253,392	23,882	21,487				
	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	567,210	540,969	48,099	45,874				
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	30,581	30,437	2,593	2,581				
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	5,418	5,274	459	447				
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	25,163	25,163	2,133	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	184,730	184,730	14,778	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	184,730	184,730	14,778	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	19,928	21,322	1,689	1,808				
	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	3,353,660	3,264,838	283,181	275,660				

(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6月期)	前四半期末 (2018年3月期)	当四半期末 (2018年6月期)	前四半期末 (2018年3月期)
1	信用リスク	2,164,369	2,124,603	183,372	180,007
2	うち、標準的手法適用分	2,105	1,502	168	120
3	うち、内部格付手法適用分	2,129,810	2,091,612	180,607	177,368
	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	32,454	31,487	2,596	2,519
4	カウンターパーティ信用リスク	58,708	62,884	4,910	5,262
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	5,077	5,347	430	453
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,349	13,929	1,067	1,114
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	716	695	57	55
	その他	39,565	42,911	3,355	3,638
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	310,918	283,920	26,365	24,076
	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	566,859	540,540	48,069	45,837
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	30,581	30,437	2,593	2,581
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	5,418	5,274	459	447
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	25,163	25,163	2,133	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	157,137	157,137	12,570	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	157,137	157,137	12,570	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	19,727	21,121	1,672	1,791
	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	3,308,301	3,220,644	279,556	272,127

(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。