

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12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12月期)	前四半期末 (2018年9月期)	当四半期末 (2018年12月期)	前四半期末 (2018年9月期)	当四半期末 (2018年12月期)	前四半期末 (2018年9月期)		
1	信用リスク	2,161,866	2,203,717	183,066	186,624				
2	うち、標準的手法適用分	5,985	5,633	478	450				
3	うち、内部格付手法適用分	2,107,693	2,151,527	178,732	182,449				
	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	3,562	3,522	284	281				
	その他	44,624	43,033	3,569	3,442				
4	カウンターパーティ信用リスク	55,590	51,662	4,644	4,319				
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	5,095	4,761	432	403				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	13,697	11,996	1,095	959				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	879	875	70	70				
	その他	35,917	34,029	3,045	2,885				
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	284,861	269,072	24,156	22,817				
	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	668,856	628,433	56,719	53,291				
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	20,248	30,385	1,717	2,576				
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	5,166	5,251	438	445				
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	15,082	25,133	1,278	2,131				
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	181,555	14,524	14,524				
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	181,555	14,524	14,524				
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	20,033	20,010	1,698	1,696				
	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	3,393,011	3,384,836	286,525	285,850				

(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2015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12月期)	前四半期末 (2018年9月期)	当四半期末 (2018年12月期)	前四半期末 (2018年9月期)
1	信用リスク	2,101,735	2,140,629	178,055	181,362
2	うち、標準的手法適用分	2,675	2,003	214	160
3	うち、内部格付手法適用分	2,065,940	2,106,786	175,191	178,655
	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	33,119	31,839	2,649	2,547
4	カウンターパーティ信用リスク	55,592	51,665	4,644	4,319
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	5,097	4,762	432	403
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	13,697	11,997	1,095	959
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	879	875	70	70
	その他	35,917	34,029	3,045	2,885
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	314,210	298,427	26,645	25,306
	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	668,427	628,052	56,682	53,258
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	20,248	30,385	1,717	2,576
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	5,166	5,251	438	445
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	15,082	25,133	1,278	2,131
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	153,716	12,297	12,297
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	153,716	12,297	12,297
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	19,840	19,819	1,682	1,680
	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	3,333,771	3,322,697	281,724	280,802

(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2015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。