

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(2019年3月期自己資本比率・速報値)

(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 (2019年3月期)	前四半期末 (2018年12月期)	当四半期末 (2019年3月期)	前四半期末 (2018年12月期)
1	信用リスク	2,201,106	2,161,866	186,413	183,066
2	うち、標準的手法適用分	4,767	5,985	381	478
3	うち、内部格付手法適用分	2,151,026	2,107,693	182,407	178,732
	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	3,625	3,562	290	284
	その他	41,687	44,624	3,334	3,569
4	カウンターパーティ信用リスク	50,422	55,590	4,213	4,644
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	4,725	5,095	400	432
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	12,115	13,697	969	1,095
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	863	879	69	70
	その他	32,718	35,917	2,774	3,045
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	272,834	284,861	23,136	24,156
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)	164,511		13,160	
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%)	56,000		4,748	
	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%)	36,719		3,113	
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%)	333,597		26,687	
	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		56,719
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	31,235	20,248	2,498	1,717
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	16,244		1,299	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	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		438
	うち、内部格付手法における 指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,991	15,082	1,199	1,278
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	181,088	181,555	14,487	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	181,088	181,555	14,487	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	27,816	20,033	2,358	1,698
	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	3,355,332	3,393,011	280,819	286,525

(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 (2019年3月期)	前四半期末 (2018年12月期)	当四半期末 (2019年3月期)	前四半期末 (2018年12月期)
		1	信用リスク	2,138,847	2,101,735
2	うち、標準的手法適用分	1,741	2,675	139	214
3	うち、内部格付手法適用分	2,106,116	2,065,940	178,598	175,191
	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	30,989	33,119	2,479	2,649
4	カウンターパーティ信用リスク	50,422	55,592	4,213	4,644
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	4,725	5,097	400	432
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	12,115	13,697	969	1,095
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	863	879	69	70
	その他	32,718	35,917	2,774	3,045
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	302,228	314,210	25,628	26,645
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)	164,464		13,157	
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%)	55,987		4,747	
	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%)	36,618		3,105	
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%)	333,138		26,651	
	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		56,682
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	31,235	20,248	2,498	1,717
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	16,244		1,299	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—		—	
	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		438
	うち、内部格付手法における 指定関数方式適用分		—		—
	うち、標準的手法適用分		—		—
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	14,991	15,082	1,199	1,278
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	153,301	153,716	12,264	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	153,301	153,716	12,264	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	27,629	19,840	2,343	1,682
	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	3,293,874	3,333,771	275,826	281,724

(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。