

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 (2019年6月期)	前四半期末 (2019年3月期)	当四半期末 (2019年6月期)	前四半期末 (2019年3月期)
1	信用リスク	2,181,217	2,201,106	184,715	186,413
2	うち、標準的手法適用分	5,840	4,767	467	381
3	うち、内部格付手法適用分	2,128,740	2,151,026	180,517	182,407
	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	3,635	3,625	290	290
	その他	43,000	41,687	3,440	3,334
4	カウンターパーティ信用リスク	54,516	50,422	4,557	4,213
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	4,574	4,725	387	400
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	12,173	12,115	973	969
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,410	863	112	69
	その他	36,358	32,718	3,083	2,774
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	258,084	272,834	21,885	23,136
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)	180,026	164,511	14,402	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%)	51,641	56,000	4,379	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%)	47,090	36,719	3,993	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%)	372,971	333,597	29,837	26,687
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	30,684	31,235	2,454	2,498
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	15,667	16,244	1,253	1,299
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	15,016	14,991	1,201	1,199
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	181,088	14,487	14,487
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	181,088	14,487	14,487
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	23,605	27,816	2,001	2,358
	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	3,380,928	3,355,332	282,714	280,819

(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6月期)	前四半期末 (2019年3月期)	当四半期末 (2019年6月期)	前四半期末 (2019年3月期)
1	信用リスク	2,119,898	2,138,847	179,600	181,217
2	うち、標準的手法適用分	2,708	1,741	216	139
3	うち、内部格付手法適用分	2,085,034	2,106,116	176,810	178,598
	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	32,155	30,989	2,572	2,479
4	カウンターパーティ信用リスク	54,517	50,422	4,557	4,213
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	4,574	4,725	387	400
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	12,173	12,115	973	969
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	1,410	863	112	69
	その他	36,358	32,718	3,083	2,774
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	287,375	302,228	24,369	25,628
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)	179,933	164,464	14,394	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%)	51,634	55,987	4,378	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%)	46,974	36,618	3,983	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%)	372,649	333,138	29,811	26,651
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	30,684	31,235	2,454	2,498
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	15,667	16,244	1,253	1,299
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	15,016	14,991	1,201	1,199
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	153,301	12,264	12,264
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	153,301	12,264	12,264
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	23,408	27,629	1,985	2,343
	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	3,320,377	3,293,874	277,799	275,826

(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。