

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(平成30年3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 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)	当四半期末 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)	当四半期末 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)	当四半期末 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)
1	信用リスク	2,171,108				183,869			
2	うち、標準的手法適用分	5,451				436			
3	うち、内部格付手法適用分	2,120,941				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	3,476				278			
	その他	41,239				3,299			
4	カウンターパーティ信用リスク	62,876				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	5,342				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	13,927				1,114			
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	695				55			
	その他	42,911				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	253,392				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	540,969				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	30,437				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	5,274				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				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				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				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	21,322				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	3,264,838				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)

国際様式の 該当番号 (注)			イ	ロ	ハ	ニ
			リスク・アセット		所要自己資本	
			当四半期末 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)	当四半期末 (30年3月期)	前四半期末 (29年12月期)
1	信用リスク	2,124,603		180,007		
2	うち、標準的手法適用分	1,502		120		
3	うち、内部格付手法適用分	2,091,612		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	31,487		2,519		
4	カウンターパーティ信用リスク	62,884		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	5,347		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	13,929		1,114		
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	695		55		
	その他	42,911		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	283,920		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	540,540		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	30,437		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	5,274		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		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		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		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	21,121		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	3,220,644		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。