

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9月末・単体)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式の該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		平成30年9月末	平成30年6月末	平成30年9月末	平成30年6月末
1	信用リスク	4,852,143	4,724,532	410,796	399,881
2	うち、標準的手法適用分	8,109	26,850	648	2,148
3	うち、内部格付手法適用分	4,713,600	4,566,508	399,713	387,239
	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	130,433	131,173	10,434	10,493
4	カウンターパーティ信用リスク	457,975	438,664	37,733	36,158
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	39,775	38,326	3,372	3,250
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	58,031	55,468	4,642	4,437
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	171,806	161,229	13,744	12,898
	その他	188,363	183,639	15,973	15,572
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	1,703,477	1,582,362	144,454	134,184
	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	25,598,404	23,496,534	2,170,716	1,992,484
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	654,444	576,103	55,496	48,853
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	654,444	576,103	55,496	48,853
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	0	0	0	0
16	マーケット・リスク	1,569,780	1,395,589	125,582	111,647
17	うち、標準的方式適用分	1,532,522	1,358,000	122,601	108,640
18	うち、内部モデル方式適用分	37,257	37,589	2,980	3,007
19	オペレーショナル・リスク	681,275	681,275	54,502	54,502
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	681,275	681,275	54,502	54,502
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	42,638	42,824	3,615	3,631
	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	35,560,140	32,937,886	3,002,898	2,781,343