

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6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6月末	平成30年3月末	平成30年6月末	平成30年3月末
1	信用リスク	4,724,532	4,629,601	399,881	391,761
2	うち、標準的手法適用分	26,850	29,963	2,148	2,397
3	うち、内部格付手法適用分	4,566,508	4,456,982	387,239	377,952
	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	131,173	142,656	10,493	11,412
4	カウンターパーティ信用リスク	438,664	480,954	36,158	39,555
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	38,326	42,302	3,250	3,587
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	55,468	64,705	4,437	5,176
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	161,229	191,435	12,898	15,314
	その他	183,639	182,511	15,572	15,476
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	1,582,362	1,589,624	134,184	134,800
	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	23,496,534	22,364,471	1,992,484	1,896,483
11	未決済取引	-	0	-	0
12	信用リスク・アセットの額の対象となっている証券化エクスポージャー	576,103	518,665	48,853	43,982
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	576,103	518,665	48,853	43,982
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	1,395,589	1,197,002	111,647	95,760
17	うち、標準的方式適用分	1,358,000	1,171,398	108,640	93,711
18	うち、内部モデル方式適用分	37,589	25,604	3,007	2,048
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	42,824	46,223	3,631	3,919
	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	32,937,886	31,507,820	2,781,343	2,660,765