

## 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12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12月末	平成30年9月末	平成30年12月末	平成30年9月末
1	信用リスク	4,846,651	4,852,143	410,218	410,796
2	うち、標準的手法適用分	20,423	8,109	1,633	648
3	うち、内部格付手法適用分	4,684,707	4,713,600	397,263	399,713
	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	141,519	130,433	11,321	10,434
4	カウンターパーティ信用リスク	553,463	457,975	45,586	37,733
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	84,944	39,775	7,203	3,372
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	109,719	58,031	8,777	4,642
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	171,017	171,806	13,681	13,744
	その他	187,781	188,363	15,923	15,973
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	1,563,138	1,703,477	132,554	144,454
	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	25,044,792	25,598,404	2,123,770	2,170,716
11	未決済取引	15,625	-	1,325	-
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	706,698	654,444	59,928	55,496
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	706,698	654,444	59,928	55,496
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	1,545,336	1,569,780	123,626	125,582
17	うち、標準的方式適用分	1,529,043	1,532,522	122,323	122,601
18	うち、内部モデル方式適用分	16,292	37,257	1,303	2,980
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	42,638	3,615	3,615
	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	34,999,620	35,560,140	2,955,127	3,002,898