

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3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	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	5,169,978	4,846,651	437,737	410,218
2	うち、標準的手法適用分	5,558	20,423	444	1,633
3	うち、内部格付手法適用分	5,028,963	4,684,707	426,456	397,263
	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	135,457	141,519	10,836	11,321
4	カウンターパーティ信用リスク	526,744	553,463	43,164	45,586
5	うち、SA-CGR適用分	54,677	-	4,636	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	-	84,944	-	7,203
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	74,451	109,719	5,956	8,777
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	238,684	171,017	19,094	13,681
	その他	158,930	187,781	13,477	15,923
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	1,705,918	1,563,138	144,661	132,554
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)	25,796,502	-	2,186,951	-
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)	1,054,709	-	89,439	-
	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%)	-	-	-	-
	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%)	40,386	-	3,424	-
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%)	1,098,816	-	87,905	-
	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	-	2,123,770
11	未決済取引	10,412	15,625	882	1,325
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	2,159,835	706,698	172,786	59,928
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	2,159,835	-	172,786	-
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	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	-	59,928
	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
	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	2,370,447	1,545,336	189,635	123,626
17	うち、標準的方式適用分	2,352,757	1,529,043	188,220	122,323
18	うち、内部モデル方式適用分	17,690	16,292	1,415	1,303
19	オペレーショナル・リスク	541,046	681,275	43,283	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	541,046	681,275	43,283	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	40,517,436	34,999,620	3,403,489	2,955,127