

自己資本比率告示第2条[第14条]各号の算式における分母の額に関する開示事項（2019年3月期 第1四半期末）

（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要(連結)					
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	
		当四半期末 2018年6月期	前四半期末 2018年3月期	当四半期末 2018年6月期	前四半期末 2018年3月期
1	信用リスク	2,049,058	2,041,792	173,301	172,685
2	うち、標準的手法適用分	4,604	4,812	368	384
3	うち、内部格付手法適用分	1,953,597	1,946,195	165,665	165,037
	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	90,856	90,784	7,268	7,262
4	カウンターパーティ信用リスク	9,462	8,749	774	718
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	3,297	3,571	279	302
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	5,717	4,936	457	394
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	21	21	1	1
	その他	426	219	36	18
7	マーケット・ベース方式にもとづく株式等エクスポージャー	14,452	15,100	1,225	1,280
	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	97,463	98,518	8,264	8,353
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	9,176	9,071	778	769
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	9,176	9,071	778	769
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	-	-	-	-
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	106,901	106,901	8,552	8,552
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	106,901	106,901	8,552	8,552
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	1,916	1,920	162	162
	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	158,657	109,760	12,692	8,780
25	合計	2,447,089	2,391,813	205,752	201,302
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,571,900	2,516,280		

(単位:百万円)

OV1 : リスク・アセットの概要(単体)					
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	
		当四半期末 2018年6月期	前四半期末 2018年3月期	当四半期末 2018年6月期	前四半期末 2018年3月期
1	信用リスク	2,027,619	2,020,054	171,643	171,003
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,965,478	1,958,181	166,672	166,053
	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	62,141	61,873	4,971	4,949
4	カウンターパーティ信用リスク	9,462	8,749	774	718
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	3,297	3,571	279	302
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	5,717	4,936	457	394
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	21	21	1	1
	その他	426	219	36	18
7	マーケット・ベース方式にもとづく株式等エクスポージャー	6,447	7,080	546	600
	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	99,314	100,387	8,421	8,512
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	9,176	9,071	778	769
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	9,176	9,071	778	769
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	-	-	-	-
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	99,323	99,323	7,945	7,945
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	99,323	99,323	7,945	7,945
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	-	-	-	-
	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	165,604	117,298	13,248	9,383
25	合計	2,416,948	2,361,965	203,359	198,933
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,541,988	2,486,666		

(単位:百万円)

CR8 : 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表(連結)			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	1,946,195	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	23,306
3		ポートフォリオの質	▲ 21,479
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	5,575
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	1,953,597

(注)項番2「資産の規模」には、項番7「為替の変動」に起因する額を含めて計上しております。
項番8「その他」には、項番2「資産の規模」と項番3「ポートフォリオの質」の複合要因による額等を計上しております。

CCR7 : 期待エクスポージャー方式を用いたカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表

当行は、与信相当額の算出に当たり、期待エクスポージャー方式を用いておりません。

MR2 : 内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

当行は、自己資本比率算出上、マーケット・リスク相当額に係る額を不算入としております。