

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 中間期末）

(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9月期	前四半期末 2018年6月期	当四半期末 2018年9月期	前四半期末 2018年6月期
1	信用リスク	2,058,791	2,049,058	174,131	173,301
2	うち、標準的手法適用分	4,668	4,604	373	368
3	うち、内部格付手法適用分	1,964,135	1,953,597	166,558	165,665
	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	89,987	90,856	7,199	7,268
4	カウンターパーティ信用リスク	12,395	9,462	1,011	774
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	3,628	3,297	307	279
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	8,225	5,717	658	457
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	29	21	2	1
	その他	511	426	43	36
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	15,385	14,452	1,304	1,225
	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	119,728	97,463	10,152	8,264
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	9,127	9,176	773	778
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	9,127	9,176	773	778
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	105,028	106,901	8,402	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	105,028	106,901	8,402	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	1,924	1,916	163	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	200,267	158,657	16,021	12,692
25	合計	2,522,649	2,447,089	211,960	205,752
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,649,508	2,571,900		

(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9月期	前四半期末 2018年6月期	当四半期末 2018年9月期	前四半期末 2018年6月期
1	信用リスク	2,037,045	2,027,619	172,444	171,643
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,975,148	1,965,478	167,492	166,672
	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	61,896	62,141	4,951	4,971
4	カウンターパーティ信用リスク	12,395	9,462	1,011	774
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	3,628	3,297	307	279
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	8,225	5,717	658	457
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	29	21	2	1
	その他	511	426	43	36
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	6,908	6,447	585	546
	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	121,666	99,314	10,316	8,421
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	9,127	9,176	773	778
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	9,127	9,176	773	778
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	97,439	99,323	7,795	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	97,439	99,323	7,795	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	209,929	165,604	16,794	13,248
25	合計	2,494,513	2,416,948	209,722	203,359
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,621,525	2,541,988		

(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	1,953,597	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	45,187
3		ポートフォリオの質	▲ 40,577
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	5,927
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	1,964,135

(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。