

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3四半期末）

(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12月期	前四半期末 2018年9月期	当四半期末 2018年12月期	前四半期末 2018年9月期
1	信用リスク	2,048,023	2,058,791	173,205	174,131
2	うち、標準的手法適用分	5,779	4,668	462	373
3	うち、内部格付手法適用分	1,950,750	1,964,135	165,423	166,558
	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	91,494	89,987	7,319	7,199
4	カウンターパーティ信用リスク	11,299	12,395	925	1,011
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	3,432	3,628	291	307
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,808	8,225	544	658
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	29	1	2
	その他	1,038	511	88	43
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	11,264	15,385	955	1,304
	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	114,527	119,728	9,711	10,152
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	9,278	9,127	786	773
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	9,278	9,127	786	773
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	105,028	8,402	8,402
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	105,028	8,402	8,402
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	1,924	163	163
	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	223,992	200,267	17,919	16,021
25	合計	2,525,339	2,522,649	212,069	211,960
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,650,862	2,649,508		

(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12月期	前四半期末 2018年9月期	当四半期末 2018年12月期	前四半期末 2018年9月期
1	信用リスク	2,024,877	2,037,045	171,408	172,444
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	1,962,050	1,975,148	166,381	167,492
	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	62,827	61,896	5,026	4,951
4	カウンターパーティ信用リスク	11,299	12,395	925	1,011
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	3,432	3,628	291	307
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	6,808	8,225	544	658
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19	29	1	2
	その他	1,038	511	88	43
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	3,118	6,908	264	585
	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	116,465	121,666	9,875	10,316
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	9,278	9,127	786	773
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	9,278	9,127	786	773
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	97,439	7,795	7,795
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	97,439	7,795	7,795
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	233,537	209,929	18,682	16,794
25	合計	2,496,015	2,494,513	209,738	209,722
	参考：合計(スケーリングファクター勘案後)	2,621,728	2,621,525		

(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	1,964,135	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	▲ 6,308
3		ポートフォリオの質	▲ 13,055
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	5,978
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	1,950,750

(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。