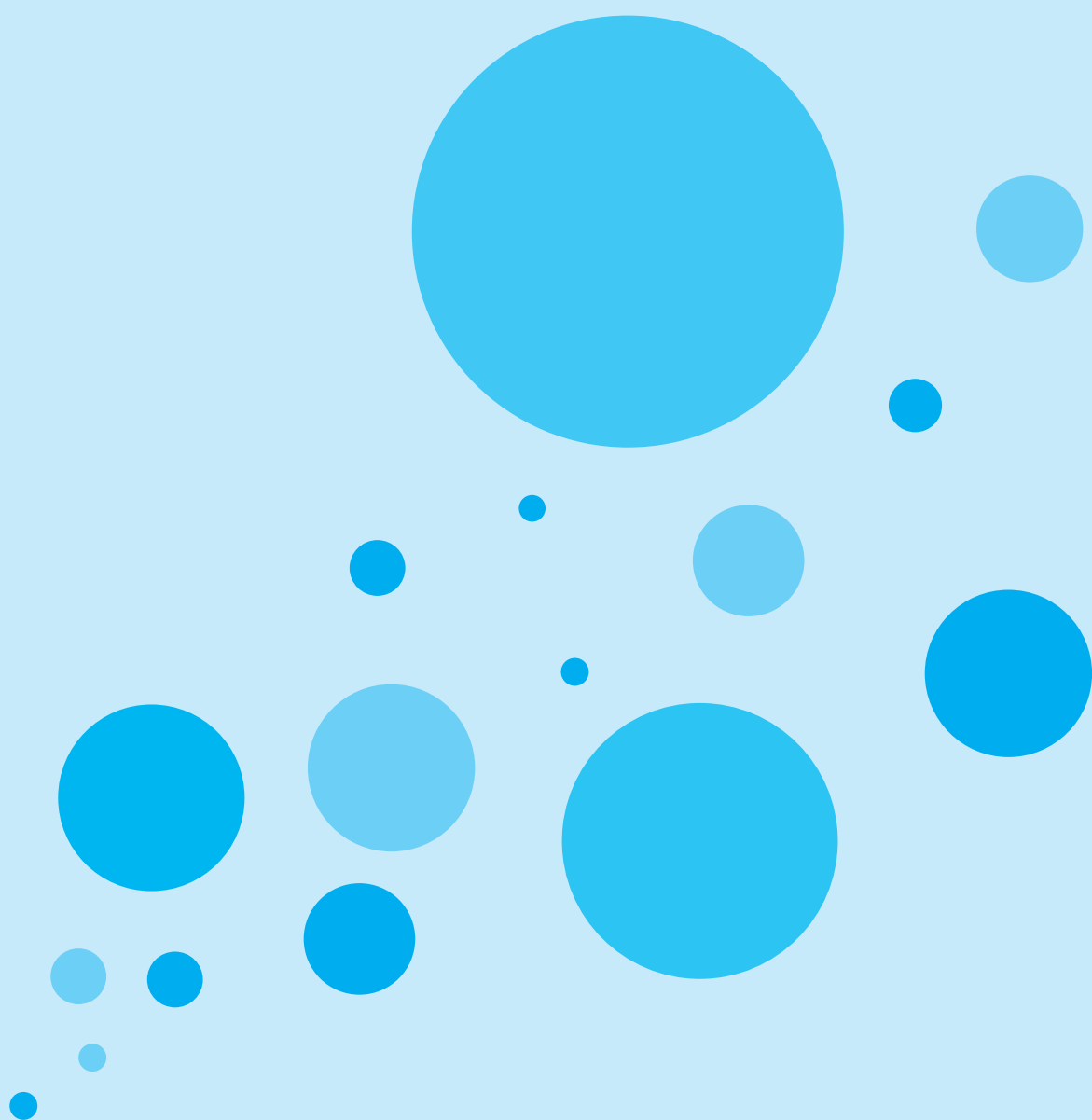


## 自己資本の充実の状況等に係る 説明資料



# 自己資本の充実の状況等に係る説明資料

2018年3月末自己資本比率等の概要

50

バーゼルⅢ第3の柱に基づく開示事項

51

自己資本の充実の状況等

I. 自己資本の構成に関する開示事項	51
II. 定性的な開示事項	
1. 連結の範囲に関する事項	57
2. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要	58
3. 連結グループ全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要	58
4. 信用リスクに関する事項	64
5. 信用リスク削減手法に関する事項	72
6. 派生商品取引及びレボ形式の取引等の相手方に対する信用リスク(カウンターパーティ信用リスク)に関する事項	72
7. 証券化取引に係るリスクに関する事項	73
8. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている株式等エクスポージャーに関する事項	74
9. マーケット・リスクに関する事項	75
10. 金利リスクに関する事項	76
11. オペレーショナル・リスクに関する事項	78
12. 貸借対照表の科目が自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明	79
13. 自己資本比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明	87
III. 定量的な開示事項(連結)	
1. 2018年3月末	88
1-1. 連結の範囲に関する事項	88
1-2. リスク・アセットの概要	88
1-3. 連結財務諸表と規制上のエクスポージャーとの間の対応関係に関する事項	89
1-4. 信用リスクに関する事項	90
1-5. 派生商品取引及びカウンターパーティ信用リスクに関する事項	103
1-6. 証券化エクスポージャーに関する事項	106
1-7. 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に関する事項	109
1-8. マーケット・リスクに関する事項	109
1-9. 金利リスクに関する事項	109
2. 2017年3月末	110
2-1. 連結の範囲に関する事項	110
2-2. 自己資本の充実度に関する事項	110
2-3. 信用リスクに関する事項	111
2-4. 信用リスク削減手法に関する事項	119
2-5. 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項	119
2-6. 証券化エクスポージャーに関する事項	120
2-7. 銀行勘定における株式等エクスポージャーに関する事項	122
2-8. 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に関する事項	123
2-9. 銀行勘定における金利リスクに関する事項	123

<b>IV. 定量的な開示事項(単体)</b>	
1. 2018年3月末	124
1-1. リスク・アセットの概要	124
1-2. 金利リスクに関する事項	125
2. 2017年3月末	126
2-1. 自己資本の充実度に関する事項	126
2-2. 信用リスクに関する事項	127
2-3. 信用リスク削減手法に関する事項	135
2-4. 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項	135
2-5. 証券化エクスポージャーに関する事項	136
2-6. 銀行勘定における株式等エクスポージャーに関する事項	138
2-7. 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に関する事項	139
2-8. 銀行勘定における金利リスクに関する事項	139
<b>V. 連結レバレッジ比率に関する開示事項</b>	140
<b>VI. 報酬等に関する開示事項</b>	
1. 当行(グループ)の対象役職員の報酬等に関する組織体制の整備状況に関する事項	141
2. 当行(グループ)の対象役職員の報酬等の体系の設計および運用の適切性の評価に関する事項	142
3. 当行(グループ)の対象役職員の報酬等の体系とリスク管理の整合性ならびに報酬等と業績の連動に関する事項	142
4. 当行(グループ)の対象役職員の報酬等の定量的な開示事項	142
5. 当行(グループ)の対象役職員の報酬等の体系に関し、その他参考となるべき事項	143

#### 流動性に係る経営の健全性の状況

<b>I. 流動性リスク管理に関する開示事項</b>	144
<b>II. 流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項</b>	145
<b>III. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(連結)</b>	146
<b>IV. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(単体)</b>	147

本ページ以降は、銀行法第21条に基づく開示事項のうち、自己資本の充実の状況に係る事項(2014年金融庁告示第7号)、流動性に係る経営の健全性の状況に係る事項(2015年金融庁告示第7号)及び報酬等に関する事項(2012年金融庁告示第21号)について記載しています。なお、本ページ以降における「自己資本比率告示」とは、2006年金融庁告示第19号を指し、「流動性カバレッジ比率告示」とは、2014年金融庁告示第60号を指しています。諸計数は原則として単位未満を切り捨てのうえ表示しています。