

自己資本の充実の状況等に係る説明資料

2018年9月末自己資本比率等の概要

41

バーゼルⅢ第3の柱に基づく開示事項

42

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	42
II. 定性的な開示事項	
1. 連結の範囲に関する事項	48
2. 中間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	49
III. 定量的な開示事項(連結)	
1. 2018年9月末	57
1-1. 連結の範囲に関する事項	57
1-2. リスク・アセットの概要	57
1-3. 信用リスクに関する事項	58
1-4. カウンターパーティ信用リスクに関する事項	65
1-5. 証券化エクスポージャーに関する事項	68
1-6. 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	71
1-7. マーケット・リスクに関する事項	71
1-8. 金利リスクに関する事項	71
2. 2017年9月末	72
2-1. 連結の範囲に関する事項	72
2-2. 自己資本の充実度に関する事項	72
2-3. 信用リスクに関する事項	73
2-4. 信用リスク削減手法に関する事項	81
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	81
2-6. 証券化エクスポージャーに関する事項	82
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	84
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	85
2-9. 銀行勘定における金利リスクに関する事項	85

IV. 定量的な開示事項(単体)

1. 2018年9月末	86
1-1. リスク・アセットの概要	86
1-2. 金利リスクに関する事項	87
2. 2017年9月末	88
2-1. 自己資本の充実度に関する事項	88
2-2. 信用リスクに関する事項	89
2-3. 信用リスク削減手法に関する事項	97
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	97
2-5. 証券化エクスポージャーに関する事項	98
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	100
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	101
2-8. 銀行勘定における金利リスクに関する事項	101

V. 連結レバレッジ比率に関する開示事項

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する事項	102
2. 前中間連結会計年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因(当該差異がある場合に限る。)	102

流動性に係る経営の健全性の状況

I. 流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項	103
II. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(連結)	104
III. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(単体)	105

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)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。