

## 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 (2024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<br>の該<br>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<br>2023年6月期 | 前四半期末<br>2023年3月期 | 当四半期末<br>2023年6月期 | 前四半期末<br>2023年3月期 |
| 1                     | 信用リスク  | 2,309,009         | 2,229,578         | 184,720           | 178,366           |
| 2                     | うち、標準的手法適用分                                      | 30,139            | 31,381            | 2,411             | 2,510             |
| 3                     | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 2,089,319         | 2,028,227         | 167,145           | 162,258           |
| 4                     | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 128,090           | 110,003           | 10,247            | 8,800             |
| 5                     | うち、先進的内部格付手法適用分                                  | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | 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  | 61,459            | 59,966            | 4,916             | 4,797             |
| 6                     | カウンターパーティ信用リスク                                   | 12,651            | 13,429            | 1,012             | 1,074             |
| 7                     | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,483             | 2,728             | 198               | 218               |
| 8                     | うち、期待エクスポージャー方式適用分                               | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                              | 913               | 868               | 73                | 69                |
| 9                     | その他  | 9,254             | 9,832             | 740               | 786               |
| 10                    | CVAリスク   | 22,192            | 16,192            | 1,775             | 1,295             |
|                       | うち、SA-CVA適用分                                     | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | うち、完全なBA-CVA適用分                                  | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | うち、限定的なBA-CVA適用分                                 | 22,192            | 16,192            | 1,775             | 1,295             |
| 11                    | 経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー           | 12,110            | 19,424            | 968               | 1,553             |
| 12                    | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(レック・スルー方式)      | 164,165           | 174,537           | 13,133            | 13,962            |
| 13                    | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンドレート方式)       | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)      | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)      | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 14                    | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%) | 9,797             | 8,433             | 783               | 674               |
| 15                    | 未決済取引  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 16                    | 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               | 28,919            | 28,872            | 2,313             | 2,309             |
| 17                    | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 18                    | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                           | 28,919            | 28,872            | 2,313             | 2,309             |
| 19                    | うち、標準的手法準拠方式適用分                                  | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                             | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 20                    | マーケット・リスク  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 21                    | うち、標準的方式適用分                                      | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 22                    | うち、内部モデル方式適用分                                    | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                       | うち、簡易的方式適用分                                      | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 23                    | 勘定間の振替分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 24                    | オペレーショナル・リスク                                     | 115,659           | 115,659           | 9,252             | 9,252             |
| 25                    | 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                 | 265               | 949               | 21                | 75                |
| 26                    | フロア調整  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 27                    | 合計   | 2,674,771         | 2,607,077         | 213,981           | 208,566           |

## OV1 : リスク・アセットの概要(単体)

| 国際様式<br>の該<br>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<br>2023年6月期 | 前四半期末<br>2023年3月期 | 当四半期末<br>2023年6月期 | 前四半期末<br>2023年3月期 |
| 1                 | 信用リスク  | 2,289,364         | 2,208,833         | 183,149           | 176,706           |
| 2                 | うち、標準的手法適用分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 3                 | うち、基礎的内部格付手法適用分                                      | 2,100,193         | 2,039,175         | 168,015           | 163,134           |
| 4                 | うち、スロッシング・クライテリア適用分                                  | 128,090           | 110,003           | 10,247            | 8,800             |
| 5                 | うち、先進的内部格付手法適用分                                      | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | 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  | 61,079            | 59,653            | 4,886             | 4,772             |
| 6                 | カウンターパーティ信用リスク                                       | 12,651            | 13,429            | 1,012             | 1,074             |
| 7                 | うち、SA-CCR適用分   | 2,483             | 2,728             | 198               | 218               |
| 8                 | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                   | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                                  | 913               | 868               | 73                | 69                |
| 9                 | その他  | 9,254             | 9,832             | 740               | 786               |
| 10                | CVAリスク   | 22,192            | 16,192            | 1,775             | 1,295             |
|                   | うち、SA-CVA適用分   | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | うち、完全なBA-CVA適用分                                      | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | うち、限定的なBA-CVA適用分                                     | 22,192            | 16,192            | 1,775             | 1,295             |
| 11                | 経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等<br>エクスポージャー           | 3,009             | 10,979            | 240               | 878               |
| 12                | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし<br>計算(ルック・スルー方式)      | 164,545           | 175,456           | 13,163            | 14,036            |
| 13                | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし<br>計算(マંデート方式)        | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし<br>計算(蓋然性方式250%)      | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし<br>計算(蓋然性方式400%)      | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 14                | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし<br>計算(フォールバック方式1250%) | 9,797             | 8,433             | 783               | 674               |
| 15                | 未決済取引  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 16                | 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<br>スポージャー               | 28,919            | 28,872            | 2,313             | 2,309             |
| 17                | うち、内部格付手法準拠方式適用分                                     | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 18                | うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分                               | 28,919            | 28,872            | 2,313             | 2,309             |
| 19                | うち、標準的手法準拠方式適用分                                      | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分                                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 20                | マーケット・リスク  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 21                | うち、標準的方式適用分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 22                | うち、内部モデル方式適用分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
|                   | うち、簡易的方式適用分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 23                | 勘定間の振替分  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 24                | オペレーショナル・リスク   | 105,523           | 105,523           | 8,441             | 8,441             |
| 25                | 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<br>ージャー                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 26                | フロア調整  | -                 | -                 | -                 | -                 |
| 27                | 合計   | 2,636,004         | 2,567,720         | 210,880           | 205,417           |

(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 | 2,138,230               |           |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額           | 資産の規模                   | 95,449    |
| 3  |                         | ポートフォリオの質               | ▲ 15,574  |
| 4  |                         | モデルの更新                  | 0         |
| 5  |                         | 手法及び方針                  | 0         |
| 6  |                         | 買収又は売却                  | 0         |
| 7  |                         | 為替の変動                   | 0         |
| 8  |                         | その他                     | ▲ 695     |
| 9  |                         | 当四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 2,217,410 |

(注) 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」の両方に該当する額等を計上しています。

**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 : 内部モデル方式によるマーケット・リスク相当額に関する内訳**

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。

**CVA4 : CVA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、CVAリスク算出にあたりSA-CVAを用いておりません。

(単位:百万円)

## CMS1 : 内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較

| 項番 |                                    | イ                       | ロ                    | ハ          | ニ  |
|----|------------------------------------|-------------------------|----------------------|------------|--|
|    |                                    | リスク・アセットの額              |                      |            |  |
|    |                                    | 内部モデルを用いて算出したリスク・アセットの額 | 標準的な手法適用分のリスク・アセットの額 | リスク・アセットの額 | 資本フロア計算に用いられる、標準的な手法により算出したリスク・アセットの額 (フロア掛目前) |
| 1  | 信用リスク                              | 2,217,410               | 30,139               | 2,247,549  | 3,241,794                                      |
| 2  | カウンターパーティ信用リスク                     | 11,737                  | 913                  | 12,651     | 54,903   |
| 3  | CVAリスク                             |                         | 22,192               | 22,192     | 23,047   |
| 4  | 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 | -                       | 28,919               | 28,919     | 28,991   |
| 5  | マーケット・リスク                          | -                       | -                    | -          | -  |
| 6  | オペレーショナル・リスク                       |                         | 115,659              | 115,659    | 115,659  |
| 7  | その他リスク・アセット                        |                         | 247,798              | 247,798    | 153,020  |
| 8  | 合計                                 | 2,229,148               | 445,623              | 2,674,771  | 3,617,417                                      |