

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 中間期末）

（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要(連結)		イ	ロ	ハ	ニ
国際様式の該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末 2023年9月期	前四半期末 2023年6月期	当四半期末 2023年9月期	前四半期末 2023年6月期
1	信用リスク	2,341,320	2,309,009	187,305	184,720
2	うち、標準的手法適用分	33,751	30,139	2,700	2,411
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,114,657	2,089,319	169,172	167,145
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	132,070	128,090	10,565	10,247
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	60,840	61,459	4,867	4,916
6	カウンターパーティ信用リスク	12,985	12,651	1,038	1,012
7	うち、SA-CCR適用分	2,628	2,483	210	198
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	1,455	913	116	73
9	その他	8,901	9,254	712	740
10	CVAリスク	23,779	22,192	1,902	1,775
	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	23,779	22,192	1,902	1,775
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	14,781	12,110	1,182	968
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）	178,932	164,165	14,314	13,133
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%）	11,110	9,797	888	783
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	28,372	28,919	2,269	2,313
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	28,372	28,919	2,269	2,313
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	118,596	115,659	9,487	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	246	265	19	21
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,730,124	2,674,771	218,409	213,981

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 2023年9月期	前四半期末 2023年6月期	当四半期末 2023年9月期	前四半期末 2023年6月期
1	信用リスク	2,317,913	2,289,364	185,433	183,149
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	2,125,343	2,100,193	170,027	168,015
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	132,070	128,090	10,565	10,247
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	60,499	61,079	4,839	4,886
6	カウンターパーティ信用リスク	12,985	12,651	1,038	1,012
7	うち、SA-CCR適用分	2,628	2,483	210	198
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	1,455	913	116	73
9	その他	8,901	9,254	712	740
10	CVAリスク	23,779	22,192	1,902	1,775
	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	23,779	22,192	1,902	1,775
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	5,867	3,009	469	240
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(ルック・スルー方式)	179,312	164,545	14,344	13,163
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(マં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 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%)	11,110	9,797	888	783
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	28,372	28,919	2,269	2,313
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	28,372	28,919	2,269	2,313
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	108,913	105,523	8,713	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 ージャー	-	-	-	-
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,688,253	2,636,004	215,060	210,880

(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	2,217,410	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	19,043
3		ポートフォリオの質	10,186
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	87
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,246,727

(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	2,246,727	33,751	2,280,479	3,294,678
2	カウンターパーティ信用リスク	11,529	1,455	12,985	54,748
3	CVAリスク		23,779	23,779	24,527
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	-	28,372	28,372	28,372
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		118,596	118,596	118,596
7	その他リスク・アセット		265,912	265,912	161,080
8	合計	2,258,257	471,867	2,730,124	3,682,004