

## 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3四半期末)

(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<br>の該<br>当番号     |  | リスク・アセット           |                   | 所要自己資本             |                   |
|                       |  | 当四半期末<br>2023年12月期 | 前四半期末<br>2023年9月期 | 当四半期末<br>2023年12月期 | 前四半期末<br>2023年9月期 |
|                       |  | 1                  | 信用リスク             | 2,357,201          | 2,341,320         |
| 2                     | うち、標準的手法適用分                                      | 35,875             | 33,751            | 2,870              | 2,700             |
| 3                     | うち、基礎的内部格付手法適用分                                  | 2,121,358          | 2,114,657         | 169,708            | 169,172           |
| 4                     | うち、スロットティング・クライテリア適用分                            | 136,804            | 132,070           | 10,944             | 10,565            |
| 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  | 63,161             | 60,840            | 5,052              | 4,867             |
| 6                     | カウンターパーティ信用リスク                                   | 13,078             | 12,985            | 1,046              | 1,038             |
| 7                     | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,868              | 2,628             | 229                | 210               |
| 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                              | 1,299              | 1,455             | 103                | 116               |
| 9                     | その他  | 8,910              | 8,901             | 712                | 712               |
| 10                    | CVAリスク   | 16,574             | 23,779            | 1,325              | 1,902             |
|                       | 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                                 | 16,574             | 23,779            | 1,325              | 1,902             |
| 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           | 19,884             | 14,781            | 1,590              | 1,182             |
| 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)      | 181,890            | 178,932           | 14,551             | 14,314            |
| 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%) | 10,797             | 11,110            | 863                | 888               |
| 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               | 26,354             | 28,372            | 2,108              | 2,269             |
| 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                           | 26,354             | 28,372            | 2,108              | 2,269             |
| 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            | 118,596           | 9,487              | 9,487             |
| 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                | 246               | 19                 | 19                |
| 26                    | フロア調整  | -                  | -                 | -                  | -                 |
| 27                    | 合計   | 2,744,624          | 2,730,124         | 219,569            | 218,409           |

## 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<br>2023年12月期 | 前四半期末<br>2023年9月期 | 当四半期末<br>2023年12月期 | 前四半期末<br>2023年9月期 |
| 1         | 信用リスク  | 2,331,638          | 2,317,913         | 186,531            | 185,433           |
| 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                                  | 2,131,996          | 2,125,343         | 170,559            | 170,027           |
| 4         | うち、スロッシング・クライテリア適用分                              | 136,804            | 132,070           | 10,944             | 10,565            |
| 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  | 62,836             | 60,499            | 5,026              | 4,839             |
| 6         | カウンターパーティ信用リスク                                   | 13,078             | 12,985            | 1,046              | 1,038             |
| 7         | うち、SA-CCR適用分                                     | 2,868              | 2,628             | 229                | 210               |
| 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                              | 1,299              | 1,455             | 103                | 116               |
| 9         | その他  | 8,910              | 8,901             | 712                | 712               |
| 10        | CVAリスク   | 16,574             | 23,779            | 1,325              | 1,902             |
|           | 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                                 | 16,574             | 23,779            | 1,325              | 1,902             |
| 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           | 10,670             | 5,867             | 853                | 469               |
| 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)      | 182,270            | 179,312           | 14,581             | 14,344            |
| 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%) | 10,797             | 11,110            | 863                | 888               |
| 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               | 26,354             | 28,372            | 2,108              | 2,269             |
| 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                           | 26,354             | 28,372            | 2,108              | 2,269             |
| 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            | 108,913           | 8,713              | 8,713             |
| 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   | 2,700,297          | 2,688,253         | 216,023            | 215,060           |

(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 | 2,246,727               |           |
| 2  | 当四半期中の要因別の変動額           | 資産の規模                   | 98,555    |
| 3  |                         | ポートフォリオの質               | ▲ 83,459  |
| 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                     | ▲ 3,661   |
| 9  |                         | 当四半期末時点における信用リスク・アセットの額 | 2,258,163 |

(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                              | 2,258,163               | 35,875               | 2,294,039  | 3,325,825                                      |
| 2  | カウンターパーティ信用リスク                     | 11,779                  | 1,299                | 13,078     | 58,512   |
| 3  | CVAリスク                             |                         | 16,574               | 16,574     | 18,539   |
| 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 | -                       | 26,354               | 26,354     | 26,354   |
| 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                        |                         | 275,981              | 275,981    | 168,195  |
| 8  | 合計                                 | 2,269,943               | 474,681              | 2,744,624  | 3,716,022                                      |