

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月期末）

（単位：百万円）

OV1：リスク・アセットの概要(連結)					
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 2024年3月期	前四半期末 2023年12月期	当四半期末 2024年3月期	前四半期末 2023年12月期
1	信用リスク	2,544,042	2,357,201	203,523	188,576
2	うち、標準的手法適用分	332,739	35,875	26,619	2,870
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,994,424	2,121,358	159,553	169,708
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	157,515	136,804	12,601	10,944
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	59,362	63,161	4,749	5,052
6	カウンターパーティ信用リスク	12,433	13,078	994	1,046
7	うち、SA-CCR適用分	2,003	2,868	160	229
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	1,313	1,299	105	103
9	その他	9,115	8,910	729	712
10	CVAリスク	15,944	16,574	1,275	1,325
	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	15,944	16,574	1,275	1,325
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	9,069	19,884	725	1,590
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）	204,202	181,890	16,336	14,551
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%）	11,169	10,797	893	863
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	24,842	26,354	1,987	2,108
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	24,842	26,354	1,987	2,108
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	122,640	118,596	9,811	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	257	246	20	19
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,944,602	2,744,624	235,568	219,569

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 2024年3月期	前四半期末 2023年12月期	当四半期末 2024年3月期	前四半期末 2023年12月期
1	信用リスク	2,519,552	2,331,638	201,564	186,531
2	うち、標準的手法適用分	303,073	-	24,245	-
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,999,898	2,131,996	159,991	170,559
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	157,515	136,804	12,601	10,944
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	59,064	62,836	4,725	5,026
6	カウンターパーティ信用リスク	12,433	13,078	994	1,046
7	うち、SA-CCR適用分	2,003	2,868	160	229
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	1,313	1,299	105	103
9	その他	9,115	8,910	729	712
10	CVAリスク	15,944	16,574	1,275	1,325
	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	15,944	16,574	1,275	1,325
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	-	853
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)	204,571	182,270	16,365	14,581
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(マंड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%)	11,169	10,797	893	863
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	24,842	26,354	1,987	2,108
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	24,842	26,354	1,987	2,108
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	112,846	108,913	9,027	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	2,901,360	2,700,297	232,108	216,023

(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	2,258,163
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 22,168
3		ポートフォリオの質 214,173
4		モデルの更新 0
5		手法及び方針 ▲ 296,126
6		買収又は売却 0
7		為替の変動 0
8		その他 ▲ 2,102
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額

(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CVAリスク相当額の変動表

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	2,151,940	332,739	2,484,680	3,549,273
2	カウンターパーティ信用リスク	11,119	1,313	12,433	54,927
3	CVAリスク		15,944	15,944	16,949
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	-	24,842	24,842	24,842
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		122,640	122,640	122,640
7	その他リスク・アセット		284,062	284,062	190,677
8	合計	2,163,060	781,542	2,944,602	3,959,311