

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 (2025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)		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 2024年6月期	前四半期末 2024年3月期	当四半期末 2024年6月期	前四半期末 2024年3月期
1	信用リスク	2,597,851	2,544,042	207,828	203,523
2	うち、標準的手法適用分	350,153	332,739	28,012	26,619
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,014,704	1,994,424	161,176	159,553
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	170,598	157,515	13,647	12,601
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	62,395	59,362	4,991	4,749
6	カウンターパーティ信用リスク	13,990	12,433	1,119	994
7	うち、SA-CCR適用分	3,321	2,003	265	160
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	1,611	1,313	128	105
9	その他	9,057	9,115	724	729
10	CVAリスク	41,364	15,944	3,309	1,275
	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	41,364	15,944	3,309	1,275
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	11,899	9,069	951	725
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)	212,948	204,202	17,035	16,336
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%)	11,502	11,169	920	893
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	24,560	24,842	1,964	1,987
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	24,560	24,842	1,964	1,987
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	122,640	9,811	9,811
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	257	20	20
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,037,017	2,944,602	242,961	235,568

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6月期	前四半期末 2024年3月期	当四半期末 2024年6月期	前四半期末 2024年3月期
1	信用リスク	2,572,760	2,519,552	205,820	201,564
2	うち、標準的手法適用分	320,177	303,073	25,614	24,245
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,021,909	1,999,898	161,752	159,991
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	170,598	157,515	13,647	12,601
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	60,075	59,064	4,806	4,725
6	カウンターパーティ信用リスク	13,990	12,433	1,119	994
7	うち、SA-CCR適用分	3,321	2,003	265	160
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	1,611	1,313	128	105
9	その他	9,057	9,115	724	729
10	CVAリスク	41,364	15,944	3,309	1,275
	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	41,364	15,944	3,309	1,275
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	3,112	-	249	-
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)	213,290	204,571	17,063	16,365
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%)	11,502	11,169	920	893
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	24,560	24,842	1,964	1,987
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	24,560	24,842	1,964	1,987
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	112,846	9,027	9,027
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	2,993,430	2,901,360	239,474	232,108

(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	2,151,940	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	▲ 65,695
3		ポートフォリオの質	119,461
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	▲ 17,198
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	▲ 3,205
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,185,302

(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	2,185,302	350,153	2,535,456	3,584,341
2	カウンターパーティ信用リスク	12,379	1,611	13,990	47,720
3	CVAリスク		41,364	41,364	42,108
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	-	24,560	24,560	24,560
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		299,003	299,003	196,670
8	合計	2,197,681	839,335	3,037,017	4,018,041