

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 中間期末)

(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9月期	前四半期末 2024年6月期	当四半期末 2024年9月期	前四半期末 2024年6月期
1	信用リスク	2,481,181	2,597,851	198,494	207,828
2	うち、標準的手法適用分	308,826	350,153	24,706	28,012
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,953,782	2,014,704	156,302	161,176
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	154,685	170,598	12,374	13,647
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	63,886	62,395	5,110	4,991
6	カウンターパーティ信用リスク	13,458	13,990	1,076	1,119
7	うち、SA-CCR適用分	2,864	3,321	229	265
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	1,431	1,611	114	128
9	その他	9,163	9,057	733	724
10	CVAリスク	19,812	41,364	1,584	3,309
	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	19,812	41,364	1,584	3,309
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	12,047	11,899	963	951
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)	209,373	212,948	16,749	17,035
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%)	10,247	11,502	819	920
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	24,398	24,560	1,951	1,964
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	24,398	24,560	1,951	1,964
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	121,315	122,640	9,705	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	239	257	19	20
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,892,074	3,037,017	231,365	242,961

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9月期	前四半期末 2024年6月期	当四半期末 2024年9月期	前四半期末 2024年6月期
1	信用リスク	2,456,362	2,572,760	196,509	205,820
2	うち、標準的手法適用分	277,049	320,177	22,163	25,614
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,967,783	2,021,909	157,422	161,752
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	154,685	170,598	12,374	13,647
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	56,844	60,075	4,547	4,806
6	カウンターパーティ信用リスク	13,458	13,990	1,076	1,119
7	うち、SA-CCR適用分	2,864	3,321	229	265
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	1,431	1,611	114	128
9	その他	9,163	9,057	733	724
10	CVAリスク	19,812	41,364	1,584	3,309
	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	19,812	41,364	1,584	3,309
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	2,963	3,112	237	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)	209,741	213,290	16,779	17,063
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%)	10,247	11,502	819	920
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	24,398	24,560	1,951	1,964
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	24,398	24,560	1,951	1,964
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	111,329	112,846	8,906	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	2,848,315	2,993,430	227,865	239,474

(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	2,185,302
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 64,187
3		ポートフォリオの質 ▲ 56,117
4		モデルの更新
5		手法及び方針 42,028
6		買収又は売却
7		為替の変動
8		その他 1,441
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	2,108,468	308,826	2,417,294	3,507,274
2	カウンターパーティ信用リスク	12,027	1,431	13,458	42,520
3	CVAリスク		19,812	19,812	21,747
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	-	24,398	24,398	24,398
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		121,315	121,315	121,315
7	その他リスク・アセット		295,794	295,794	195,801
8	合計	2,120,495	771,578	2,892,074	3,913,057