

## 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3四半期末)

(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12月期	前四半期末 2024年9月期	当四半期末 2024年12月期	前四半期末 2024年9月期
1	信用リスク	2,530,408	2,481,181	202,432	198,494
2	うち、標準的手法適用分	309,584	308,826	24,766	24,706
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,985,019	1,953,782	158,801	156,302
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	160,478	154,685	12,838	12,374
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	75,326	63,886	6,026	5,110
6	カウンターパーティ信用リスク	11,018	13,458	881	1,076
7	うち、SA-CCR適用分	2,245	2,864	179	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	1,722	1,431	137	114
9	その他	7,050	9,163	564	733
10	CVAリスク	18,696	19,812	1,495	1,584
	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	18,696	19,812	1,495	1,584
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	11,923	12,047	953	963
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)	246,632	209,373	19,730	16,749
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%)	10,015	10,247	801	819
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	23,604	24,398	1,888	1,951
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	23,604	24,398	1,888	1,951
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	121,315	9,705	9,705
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	239	19	19
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	2,973,853	2,892,074	237,908	231,365

## 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12月期	前四半期末 2024年9月期	当四半期末 2024年12月期	前四半期末 2024年9月期
1	信用リスク	2,501,270	2,456,362	200,101	196,509
2	うち、標準的手法適用分	273,717	277,049	21,897	22,163
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,999,704	1,967,783	159,976	157,422
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	160,478	154,685	12,838	12,374
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	67,369	56,844	5,389	4,547
6	カウンターパーティ信用リスク	11,018	13,458	881	1,076
7	うち、SA-CCR適用分	2,245	2,864	179	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	1,722	1,431	137	114
9	その他	7,050	9,163	564	733
10	CVAリスク	18,696	19,812	1,495	1,584
	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	18,696	19,812	1,495	1,584
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	3,114	2,963	249	237
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)	247,011	209,741	19,760	16,779
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%)	10,015	10,247	801	819
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	23,604	24,398	1,888	1,951
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	23,604	24,398	1,888	1,951
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	111,329	8,906	8,906
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	2,926,060	2,848,315	234,084	227,865

(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	2,108,468
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 6,270
3		ポートフォリオの質 40,261
4		モデルの更新
5		手法及び方針 3,144
6		買収又は売却
7		為替の変動
8		その他 ▲ 106
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	2,145,497	309,584	2,455,082	3,590,339
2	カウンターパーティ信用リスク	9,295	1,722	11,018	37,425
3	CVAリスク		18,696	18,696	20,300
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	-	23,604	23,604	23,604
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		344,137	344,137	227,739
8	合計	2,154,793	819,060	2,973,853	4,020,724