

## 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 2025年3月期	前四半期末 2024年12月期	当四半期末 2025年3月期	前四半期末 2024年12月期
1	信用リスク	2,550,055	2,530,408	204,004	202,432
2	うち、標準的手法適用分	337,862	309,584	27,029	24,766
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,977,899	1,985,019	158,231	158,801
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	159,728	160,478	12,778	12,838
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	74,564	75,326	5,965	6,026
6	カウンターパーティ信用リスク	8,197	11,018	655	881
7	うち、SA-CCR適用分	2,449	2,245	195	179
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	1,962	1,722	157	137
9	その他	3,784	7,050	302	564
10	CVAリスク	13,528	18,696	1,082	1,495
	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	13,528	18,696	1,082	1,495
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	12,437	11,923	994	953
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）	256,877	246,632	20,550	19,730
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%）	7,986	10,015	638	801
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	22,486	23,604	1,798	1,888
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	22,486	23,604	1,798	1,888
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	132,408	121,315	10,592	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	2,333	239	186	19
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,006,311	2,973,853	240,504	237,908

## 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 2025年3月期	前四半期末 2024年12月期	当四半期末 2025年3月期	前四半期末 2024年12月期
1	信用リスク	2,521,470	2,501,270	201,717	200,101
2	うち、標準的手法適用分	303,116	273,717	24,249	21,897
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,993,304	1,999,704	159,464	159,976
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	159,728	160,478	12,778	12,838
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	65,320	67,369	5,225	5,389
6	カウンターパーティ信用リスク	8,197	11,018	655	881
7	うち、SA-CCR適用分	2,449	2,245	195	179
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	1,962	1,722	157	137
9	その他	3,784	7,050	302	564
10	CVAリスク	13,528	18,696	1,082	1,495
	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	13,528	18,696	1,082	1,495
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	4,245	3,114	339	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)	260,478	247,011	20,838	19,760
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%)	7,986	10,015	638	801
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	22,486	23,604	1,798	1,888
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	22,486	23,604	1,798	1,888
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	121,880	111,329	9,750	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	2,960,273	2,926,060	236,821	234,084

(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	2,145,497
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模 ▲ 22,520
3		ポートフォリオの質 42,654
4		モデルの更新
5		手法及び方針 ▲ 27,606
6		買収又は売却
7		為替の変動
8		その他 ▲ 397
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	2,137,627	337,862	2,475,490	3,651,838
2	カウンターパーティ信用リスク	6,234	1,962	8,197	19,215
3	CVAリスク		13,528	13,528	15,796
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	-	22,486	22,486	22,486
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		132,408	132,408	132,408
7	その他リスク・アセット		354,199	354,199	254,709
8	合計	2,143,862	862,449	3,006,311	4,096,455