

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 (2026年3月期 第1四半期末)

(単位:百万円)

0V1 : 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6月期	前四半期末 2025年3月期	当四半期末 2025年6月期	前四半期末 2025年3月期
		1	信用リスク	2,551,765	2,550,055
2	うち、標準的手法適用分	347,974	337,862	27,837	27,029
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,976,632	1,977,899	158,130	158,231
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	156,953	159,728	12,556	12,778
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	70,204	74,564	5,616	5,965
6	カウンターパーティ信用リスク	9,414	8,197	753	655
7	うち、SA-CCR適用分	3,418	2,449	273	195
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	2,200	1,962	176	157
9	その他	3,795	3,784	303	302
10	CVAリスク	16,102	13,528	1,288	1,082
	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	16,102	13,528	1,288	1,082
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	14,144	12,437	1,131	994
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)	264,165	256,877	21,133	20,550
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%)	7,417	7,986	593	638
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	22,044	22,486	1,763	1,798
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	22,044	22,486	1,763	1,798
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	132,408	10,592	10,592
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	2,333	186	186
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,019,797	3,006,311	241,583	240,504

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6月期	前四半期末 2025年3月期	当四半期末 2025年6月期	前四半期末 2025年3月期
1	信用リスク	2,525,280	2,521,470	202,022	201,717
2	うち、標準的手法適用分	315,520	303,116	25,241	24,249
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,991,081	1,993,304	159,286	159,464
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	156,953	159,728	12,556	12,778
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	61,725	65,320	4,938	5,225
6	カウンターパーティ信用リスク	9,414	8,197	753	655
7	うち、SA-CCR適用分	3,418	2,449	273	195
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	2,200	1,962	176	157
9	その他	3,795	3,784	303	302
10	CVAリスク	16,102	13,528	1,288	1,082
	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	16,102	13,528	1,288	1,082
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	6,095	4,245	487	339
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)	267,508	260,478	21,400	20,838
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(マંデート方式)	-	-	-	-
	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%)	7,417	7,986	593	638
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	22,044	22,486	1,763	1,798
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	22,044	22,486	1,763	1,798
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	121,880	9,750	9,750
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	2,975,744	2,960,273	238,059	236,821

(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	2,137,627	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	46,232
3		ポートフォリオの質	▲ 37,082
4		モデルの更新	0
5		手法及び方針	▲ 12,487
6		買収又は売却	0
7		為替の変動	0
8		その他	▲ 704
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,133,586

(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	2,133,586	347,974	2,481,560	3,663,062
2	カウンターパーティ信用リスク	7,213	2,200	9,414	22,470
3	CVAリスク		16,102	16,102	19,269
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	-	22,044	22,044	22,044
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		358,265	358,265	254,068
8	合計	2,140,799	878,997	3,019,797	4,113,324