

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 中間期末)

(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9月期	前四半期末 2025年6月期	当四半期末 2025年9月期	前四半期末 2025年6月期
1	信用リスク	2,599,726	2,551,765	207,978	204,141
2	うち、標準的手法適用分	383,788	347,974	30,703	27,837
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	1,988,048	1,976,632	159,043	158,130
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	162,699	156,953	13,015	12,556
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	65,189	70,204	5,215	5,616
6	カウンターパーティ信用リスク	8,663	9,414	693	753
7	うち、SA-CCR適用分	2,825	3,418	226	273
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	2,914	2,200	233	176
9	その他	2,924	3,795	233	303
10	CVAリスク	16,877	16,102	1,350	1,288
	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	16,877	16,102	1,350	1,288
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	30,926	14,144	2,474	1,131
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)	288,590	264,165	23,087	21,133
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%)	6,609	7,417	528	593
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	21,155	22,044	1,692	1,763
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	21,155	22,044	1,692	1,763
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	135,268	132,408	10,821	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	3,016	2,333	241	186
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,110,834	3,019,797	248,866	241,583

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9月期	前四半期末 2025年6月期	当四半期末 2025年9月期	前四半期末 2025年6月期
1	信用リスク	2,589,273	2,525,280	207,141	202,022
2	うち、標準的手法適用分	341,900	315,520	27,352	25,241
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,027,778	1,991,081	162,222	159,286
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	162,699	156,953	13,015	12,556
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	56,894	61,725	4,551	4,938
6	カウンターパーティ信用リスク	8,663	9,414	693	753
7	うち、SA-CCR適用分	2,825	3,418	226	273
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	2,914	2,200	233	176
9	その他	2,924	3,795	233	303
10	CVAリスク	16,877	16,102	1,350	1,288
	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	16,877	16,102	1,350	1,288
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	22,626	6,095	1,810	487
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)	291,185	267,508	23,294	21,400
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%)	6,609	7,417	528	593
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	21,155	22,044	1,692	1,763
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	21,155	22,044	1,692	1,763
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	124,281	121,880	9,942	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	3,080,671	2,975,744	246,453	238,059

(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	2,133,586	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	▲ 19,427
3		ポートフォリオの質	70,574
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	▲ 33,423
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	▲ 561
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,150,748

(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	2,150,748	383,788	2,534,537	3,745,444
2	カウンターパーティ信用リスク	5,749	2,914	8,663	18,965
3	CVAリスク		16,877	16,877	19,182
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	-	21,155	21,155	21,155
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		135,268	135,268	135,268
7	その他リスク・アセット		394,332	394,332	269,278
8	合計	2,156,498	954,336	3,110,834	4,209,295