

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 2026年3月期	前四半期末 2025年12月期	当四半期末 2026年3月期	前四半期末 2025年12月期
1	信用リスク	2,871,976	2,672,861	229,758	213,828
2	うち、標準的手法適用分	397,333	393,876	31,786	31,510
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,233,475	2,042,765	178,678	163,421
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	175,906	168,582	14,072	13,486
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	65,260	67,637	5,220	5,411
6	カウンターパーティ信用リスク	7,928	7,888	634	631
7	うち、SA-CCR適用分	1,811	1,887	144	150
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	3,584	3,389	286	271
9	その他	2,532	2,611	202	208
10	CVAリスク	14,526	13,815	1,162	1,105
	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	14,526	13,815	1,162	1,105
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	47,041	35,460	3,763	2,836
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)	308,948	293,369	24,715	23,469
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%)	3,358	5,927	268	474
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	17,373	19,698	1,389	1,575
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	17,373	19,698	1,389	1,575
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	146,268	135,268	11,701	10,821
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	3,335	3,258	266	260
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	3,420,758	3,187,549	273,660	255,003

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 2026年3月期	前四半期末 2025年12月期	当四半期末 2026年3月期	前四半期末 2025年12月期
1	信用リスク	2,866,411	2,660,964	229,312	212,877
2	うち、標準的手法適用分	350,613	349,261	28,049	27,940
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,282,985	2,083,654	182,638	166,692
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	175,906	168,582	14,072	13,486
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	56,905	59,466	4,552	4,757
6	カウンターパーティ信用リスク	7,928	7,888	634	631
7	うち、SA-CCR適用分	1,811	1,887	144	150
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	3,584	3,389	286	271
9	その他	2,532	2,611	202	208
10	CVAリスク	14,526	13,815	1,162	1,105
	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	14,526	13,815	1,162	1,105
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	37,656	26,469	3,012	2,117
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)	312,482	295,310	24,998	23,624
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%)	3,358	5,927	268	474
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	17,373	19,698	1,389	1,575
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	17,373	19,698	1,389	1,575
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	135,261	124,281	10,820	9,942
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	3,395,000	3,154,356	271,600	252,348

(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	2,211,347	
2	当四半期中の要因別の変動額	資産の規模	10,062
3		ポートフォリオの質	188,558
4		モデルの更新	0
5		手法及び方針	▲ 1,326
6		買収又は売却	0
7		為替の変動	0
8		その他	741
9		当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	2,409,382

(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	2,409,382	397,333	2,806,715	3,991,003
2	カウンターパーティ信用リスク	4,344	3,584	7,928	19,986
3	CVAリスク		14,526	14,526	15,382
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	-	17,373	17,373	17,373
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		146,268	146,268	146,268
7	その他リスク・アセット		427,944	427,944	335,780
8	合計	2,413,726	1,007,031	3,420,758	4,525,795