

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（2027年3月期 第1四半期末）

（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 2026年6月期	前四半期末 2026年3月期	当四半期末 2026年6月期	前四半期末 2026年3月期
1	信用リスク	3,276,859	2,871,976	262,148	229,758
2	うち、標準的手法適用分	742,231	397,333	59,378	31,786
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2,280,928	2,233,475	182,474	178,678
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	187,023	175,906	14,961	14,072
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	66,675	65,260	5,334	5,220
6	カウンターパーティ信用リスク	8,378	7,928	670	634
7	うち、SA-CCR適用分	1,549	1,811	123	144
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	3,909	3,584	312	286
9	その他	2,919	2,532	233	202
10	CVAリスク	11,375	14,526	910	1,162
	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	11,375	14,526	910	1,162
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	68,582	47,041	5,486	3,763
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）	308,760	308,948	24,700	24,715
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％）	1,466	3,358	117	268
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	18,175	17,373	1,454	1,389
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	18,175	17,373	1,454	1,389
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	146,268	11,701	11,701
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	8,400	3,335	672	266
26	フロア調整	－	－	－	－
27	合計	3,848,267	3,420,758	307,861	273,660

(単位:百万円)

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6月期	前四半期末 2026年3月期	当四半期末 2026年6月期	前四半期末 2026年3月期
1	信用リスク	3, 272, 652	2, 866, 411	261, 812	229, 312
2	うち、標準的手法適用分	696, 007	350, 613	55, 680	28, 049
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	2, 331, 260	2, 282, 985	186, 500	182, 638
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	187, 023	175, 906	14, 961	14, 072
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	58, 360	56, 905	4, 668	4, 552
6	カウンターパーティ信用リスク	8, 378	7, 928	670	634
7	うち、SA-CCR適用分	1, 549	1, 811	123	144
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, 909	3, 584	312	286
9	その他	2, 919	2, 532	233	202
10	CVAリスク	11, 375	14, 526	910	1, 162
	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	11, 375	14, 526	910	1, 162
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	58, 203	37, 656	4, 656	3, 012
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）	318, 302	312, 482	25, 464	24, 998
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％）	1, 466	3, 358	117	268
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	18, 175	17, 373	1, 454	1, 389
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	18, 175	17, 373	1, 454	1, 389
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	135, 261	10, 820	10, 820
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, 823, 815	3, 395, 000	305, 905	271, 600

(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		2,409,382
2		資産の規模	107,301
3		ポートフォリオの質	285,575
4		モデルの更新	0
5		手法及び方針	▲ 345,411
6		買収又は売却	0
7		為替の変動	0
8		その他	11,103
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額		2,467,952

(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	2,467,952	742,231	3,210,183	4,353,418
2	カウンターパーティ信用リスク	4,468	3,909	8,378	21,685
3	CVAリスク		11,375	11,375	12,420
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	-	18,175	18,175	18,175
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		453,885	453,885	348,978
8	合計	2,472,421	1,375,846	3,848,267	4,900,947