

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項
(2024年3月期自己資本比率)

(別紙様式第八号第六面)

(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	二
		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	2,845,676	409,813	3,255,490	5,000,997
2	カウンターパーティ信用リスク	40,499	1,382	41,881	73,775
3	CVAリスク		15,557	15,557	17,084
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トジャー	—	43,033	43,033	43,033
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーションナル・リスク		206,114	206,114	206,114
7	その他リスク・アセット		1,310,285	1,310,285	880,828
8	合計	2,886,176	1,986,186	4,872,362	6,221,833