

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9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	2,830,812	376,398	3,207,210	4,956,079
2	カウンターパーティ信用リスク	41,678	1,589	43,268	76,251
3	CVAリスク		24,210	24,210	28,371
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	—	47,424	47,424	47,424
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーションナル・リスク		228,316	228,316	228,316
7	その他リスク・アセット		1,239,208	1,239,208	825,877
8	合計	2,872,491	1,917,146	4,789,637	6,162,320