

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12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	3,163,799	352,533	3,516,332	4,997,726
2	カウンターパーティ信用リスク	40,157	1,427	41,585	72,791
3	CVAリスク		20,986	20,986	23,628
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	—	49,446	49,446	49,446
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		1,290,262	1,290,262	875,230
8	合計	3,203,956	1,942,972	5,146,929	6,247,139