

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6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	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	2,842,442	401,919	3,244,361	5,003,652
2	カウンターパーティ信用リスク	44,198	1,398	45,597	80,965
3	CVAリスク		19,937	19,937	22,668
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	—	44,866	44,866	44,866
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		206,114	206,114	206,114
7	その他リスク・アセット		1,383,560	1,383,560	929,061
8	合計	2,886,641	2,057,796	4,944,438	6,287,328