

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  
(2025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          | 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                              | 2,874,407               | 520,291              | 3,394,698  | 5,037,702                                     |
| 2                                  | カウンターパーティ信用リスク                     | 41,582                  | 1,230                | 42,812     | 68,396  |
| 3                                  | CVAリスク                             |                         | 17,125               | 17,125     | 19,667  |
| 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 | —                       | 29,079               | 29,079     | 29,079  |
| 5                                  | マーケット・リスク                          | —                       | —                    | —          | —   |
| 6                                  | オペレーショナル・リスク                       |                         | 242,080              | 242,080    | 242,080                                       |
| 7                                  | その他リスク・アセット                        |                         | 1,348,003            | 1,348,003  | 984,555                                       |
| 8                                  | 合計                                 | 2,915,989               | 2,157,810            | 5,073,800  | 6,381,481                                     |