

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	2,999,393	520,919	3,520,313	5,148,174
2	カウンターパーティ信用リスク	34,388	1,767	36,155	58,999
3	CVAリスク		18,854	18,854	22,554
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	—	28,779	28,779	28,779
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		1,340,721	1,340,721	980,876
8	合計	3,033,782	2,153,123	5,186,906	6,481,465