

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	3,083,609	529,681	3,613,290	5,226,805
2	カウンターパーティ信用リスク	33,084	2,090	35,174	55,202
3	CVAリスク		13,405	13,405	16,451
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	—	30,938	30,938	30,938
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーションナル・リスク		266,967	266,967	266,967
7	その他リスク・アセット		1,423,656	1,423,656	1,017,629
8	合計	3,116,693	2,266,739	5,383,433	6,613,995