

標準的な手法により算出した連結リスク・アセットとの比較
(2026年3月末)

(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な手法のリスク・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	2,676,595	702,822	3,379,417	5,962,231
2	カウンターパーティ信用リスク	25,805	-	25,805	27,632
3	CVAリスク		24,771	24,771	27,505
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	-	1,972	1,972	1,972
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		157,250	157,250	157,250
7	その他リスク・アセット		318,726	318,726	337,625
8	合計	2,702,400	1,205,542	3,907,942	6,514,217