

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
(2023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	2,506,820	762,818	3,269,638	5,184,123
2	カウンターパーティ信用リスク	16,382	-	16,382	29,672
3	CVAリスク		20,350	20,350	22,088
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	-	14,263	14,263	14,263
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		233,175	233,175	233,175
7	その他リスク・アセット		280,816	280,816	303,337
8	合計	2,523,203	1,311,424	3,834,627	5,786,662