

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6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	2,558,092	595,533	3,153,625	5,062,301
2	カウンターパーティ信用リスク	18,021	-	18,021	25,001
3	CVAリスク		15,396	15,396	16,743
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	-	15,554	15,554	15,554
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		269,064	269,064	284,995
8	合計	2,576,113	1,128,724	3,704,838	5,637,772