

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9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	2,554,734	785,385	3,340,120	5,352,842
2	カウンターパーティ信用リスク	17,780	-	17,780	19,544
3	CVAリスク		17,732	17,732	18,445
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	-	17,062	17,062	17,062
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		226,561	226,561	226,561
7	その他リスク・アセット		282,132	282,132	301,845
8	合計	2,572,515	1,328,874	3,901,390	5,936,302