

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12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	2,454,195	635,012	3,089,208	5,230,287
2	カウンターパーティ信用リスク	20,018	-	20,018	26,819
3	CVAリスク		19,987	19,987	20,766
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	-	15,380	15,380	15,380
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		272,289	272,289	294,904
8	合計	2,474,213	1,169,231	3,643,445	5,814,720