

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
(2024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	2,546,253	849,281	3,395,535	5,598,179
2	カウンターパーティ信用リスク	19,282	-	19,282	23,237
3	CVAリスク		18,105	18,105	18,766
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	-	16,473	16,473	16,473
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		132,955	132,955	132,955
7	その他リスク・アセット		257,767	257,767	289,270
8	合計	2,565,536	1,274,583	3,840,120	6,078,882