

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	2,576,642	704,475	3,281,117	5,512,222
2	カウンターパーティ信用リスク	20,047	-	20,047	22,084
3	CVAリスク		18,804	18,804	19,368
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	-	16,865	16,865	16,865
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		275,356	275,356	293,025
8	合計	2,596,690	1,148,457	3,745,147	5,996,521