

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	2,581,680	818,362	3,400,043	5,689,714
2	カウンターパーティ信用リスク	26,056	-	26,056	32,711
3	CVAリスク		35,601	35,601	38,294
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	-	13,207	13,207	13,207
5	マーケット・リスク	-	-	-	-
6	オペレーショナル・リスク		135,892	135,892	135,892
7	その他リスク・アセット		265,082	265,082	281,668
8	合計	2,607,737	1,268,145	3,875,883	6,191,489