

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	2,640,810	792,472	3,433,282	5,812,510
2	カウンターパーティ信用リスク	21,790	-	21,790	21,790
3	CVAリスク		24,660	24,660	26,915
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	-	13,021	13,021	13,021
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		278,132	278,132	605,052
8	合計	2,662,601	1,244,179	3,906,780	6,615,182