

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  
(2025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                              | 2,673,957               | 958,603              | 3,632,561  | 6,041,603                                     |
| 2                                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 24,854                  | －                    | 24,854     | 30,112  |
| 3                                   | CVAリスク                             |                         | 32,892               | 32,892     | 37,290  |
| 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 | －                       | 8,804                | 8,804      | 8,804   |
| 5                                   | マーケット・リスク                          | －                       | －                    | －          | －   |
| 6                                   | オペレーショナル・リスク                       |                         | 135,207              | 135,207    | 135,207                                       |
| 7                                   | その他リスク・アセット                        |                         | 289,149              | 289,149    | 306,095                                       |
| 8                                   | 合計                                 | 2,698,812               | 1,424,658            | 4,123,470  | 6,559,113                                     |