

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
(2026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	2,652,389	685,578	3,337,967	5,951,922
2	カウンターパーティ信用リスク	26,408	－	26,408	28,452
3	CVAリスク		26,119	26,119	29,185
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	－	1,315	1,315	1,315
5	マーケット・リスク	－	－	－	－
6	オペレーショナル・リスク		157,250	157,250	157,250
7	その他リスク・アセット		321,052	321,052	340,294
8	合計	2,678,797	1,191,316	3,870,114	6,508,420