

内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・アセットの比較（2024年3月末）

（単位：百万円）

CMS1:内部モデルを用いた手法と標準的手法のリスク・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	4,975,390	76,124	5,051,515	9,542,725
2	カウンターパーティ信用リスク	26,610	5,129	31,740	51,571
3	CVAリスク		73,152	73,152	73,152
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	-	-	-	-
5	マーケット・リスク	-	84,968	84,968	84,968
6	オペレーショナル・リスク		222,319	222,319	222,319
7	その他リスク・アセット		1,438,970	1,438,970	693,182
8	合計	5,002,001	1,900,664	6,902,665	10,667,919