

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6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	5,003,887	74,883	5,078,771	9,577,215
2	カウンターパーティ信用リスク	25,318	5,290	30,609	48,720
3	CVAリスク		84,394	84,394	84,394
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	-	93,220	93,220	93,220
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		1,509,092	1,509,092	741,690
8	合計	5,029,206	1,989,200	7,018,407	10,767,562