

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9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	4,962,895	74,671	5,037,566	9,611,137
2	カウンターパーティ信用リスク	27,112	5,307	32,419	55,874
3	CVAリスク		73,817	73,817	73,817
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	-	79,605	79,605	79,605
6	オペレーショナル・リスク		225,186	225,186	225,186
7	その他リスク・アセット		1,541,074	1,541,074	770,054
8	合計	4,990,007	1,999,662	6,989,669	10,815,674