

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12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	5,037,540	93,891	5,131,431	9,771,981
2	カウンターパーティ信用リスク	24,287	4,784	29,072	48,935
3	CVAリスク		72,989	72,989	72,989
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		84,984	84,984	84,984
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		1,620,394	1,620,394	807,778
8	合計	5,061,827	2,102,231	7,164,059	11,011,856