

## 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（2023年3月末）

【連結】

（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	4,049,271	127,927	4,177,199	8,040,012
2	カウンターパーティ信用リスク	43,499	929	44,428	90,238
3	CVAリスク		176,214	176,214	180,979
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	-	77,163	77,163	77,163
5	マーケット・リスク	-	557	557	557
6	オペレーショナル・リスク		175,111	175,111	175,111
7	その他リスク・アセット		808,576	808,576	482,757
8	合計	4,092,771	1,366,480	5,459,251	9,046,820

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（2023年3月末）

【連結】

（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	4,061,319	8,423	4,069,743	7,962,572
2	カウンターパーティ信用リスク	43,504	929	44,433	90,240
3	CVAリスク		176,216	176,216	180,981
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	-	77,163	77,163	77,163
5	マーケット・リスク	-	990	990	990
6	オペレーショナル・リスク		171,834	171,834	171,834
7	その他リスク・アセット		750,620	750,620	417,559
8	合計	4,104,823	1,186,177	5,291,001	8,901,342