

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）

【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	3,732,466	618,249	4,350,715	8,444,168
2	カウンターパーティ信用リスク	41,045	678	41,724	84,037
3	CVAリスク		155,079	155,079	158,859
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	-	76,568	76,568	76,568
5	マーケット・リスク	-	132	132	132
6	オペレーショナル・リスク		190,342	190,342	190,342
7	その他リスク・アセット		937,479	937,479	635,862
8	合計	3,773,512	1,978,530	5,752,042	9,589,971

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）

【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	3,674,579	607,578	4,282,157	8,378,222
2	カウンターパーティ信用リスク	41,045	678	41,724	84,037
3	CVAリスク		155,079	155,079	158,859
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	-	76,568	76,568	76,568
5	マーケット・リスク	-	122	122	122
6	オペレーショナル・リスク		177,628	177,628	177,628
7	その他リスク・アセット		847,574	847,574	539,140
8	合計	3,715,625	1,865,231	5,580,856	9,414,580