

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

(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                              | 2,059,741               | 16,325               | 2,076,066  | 3,196,583                                     |
| 2                                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 26,048                  | 811                  | 26,859     | 31,779  |
| 3                                   | CVARリスク                            |                         | 39,203               | 39,203     | 53,173  |
| 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 | —                       | 6,450                | 6,450      | 6,450   |
| 5                                   | マーケット・リスク                          | —                       | —                    | —          | —   |
| 6                                   | オペレーショナル・リスク                       |                         | 69,124               | 69,124     | 69,124  |
| 7                                   | その他リスク・アセット                        |                         | 540,206              | 540,206    | 232,123                                       |
| 8                                   | 合計                                 | 2,085,789               | 672,120              | 2,757,910  | 3,589,235                                     |