

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                                             |
|                                     |                                    | 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                              | 1,927,252               | 85,941               | 2,013,194                                     |
| 2                                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 27,701                  | 672                  | 28,373                                        |
| 3                                   | CVAリスク                             |                         | 28,595               | 28,595                                        |
| 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 | —                       | 6,649                | 6,649                                         |
| 5                                   | マーケット・リスク                          | —                       | —                    | —                                             |
| 6                                   | オペレーショナル・リスク                       |                         | 74,620               | 74,620                                        |
| 7                                   | その他リスク・アセット                        |                         | 729,670              | 729,670                                       |
| 8                                   | 合計                                 | 1,954,953               | 926,150              | 2,881,104                                     |
|                                     |                                    |                         |                      | 3,652,225                                     |