

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                              | 1,891,071               | 97,543               | 1,988,614  | 3,094,514                                     |
| 2                                   | カウンターパーティ信用リスク                     | 22,454                  | 713                  | 23,168     | 26,708                                        |
| 3                                   | CVAリスク                             |                         | 34,123               | 34,123     | 40,413                                        |
| 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 | —                       | 7,526                | 7,526      | 7,526                                         |
| 5                                   | マーケット・リスク                          | —                       | —                    | —          | —                                             |
| 6                                   | オペレーショナル・リスク                       |                         | 72,698               | 72,698     | 72,698                                        |
| 7                                   | その他リスク・アセット                        |                         | 764,082              | 764,082    | 451,060                                       |
| 8                                   | 合計                                 | 1,913,526               | 976,687              | 2,890,213  | 3,692,922                                     |