

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6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 | 4,087,266 | 127,476 | 4,214,742 | 8,098,845 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 42,481 | 646 | 43,127 | 87,381 |
| 3 | CVAリスク | | 163,774 | 163,774 | 168,305 |
| 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 | - | 82,422 | 82,422 | 82,422 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 488 | 488 | 488 |
| 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 | | 818,200 | 818,200 | 492,552 |
| 8 | 合計 | 4,129,747 | 1,368,120 | 5,497,868 | 9,105,106 |

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6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 | 4,099,470 | 7,816 | 4,107,287 | 8,021,836 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 42,483 | 646 | 43,130 | 87,382 |
| 3 | CVAリスク | | 163,775 | 163,775 | 168,306 |
| 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 | - | 82,422 | 82,422 | 82,422 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 529 | 529 | 529 |
| 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 | | 755,089 | 755,089 | 421,897 |
| 8 | 合計 | 4,141,954 | 1,182,113 | 5,324,068 | 8,954,208 |