

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12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 | 3,991,409 | 131,561 | 4,122,971 | 8,108,141 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 42,728 | 358 | 43,086 | 87,358 |
| 3 | CVAリスク | | 160,707 | 160,707 | 165,256 |
| 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 | - | 77,395 | 77,395 | 77,395 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 458 | 458 | 458 |
| 6 | オペレーショナル・リスク | | 181,855 | 181,855 | 181,855 |
| 7 | その他リスク・アセット | | 850,099 | 850,099 | 513,959 |
| 8 | 合計 | 4,034,137 | 1,402,437 | 5,436,574 | 9,134,426 |

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12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 | 4,002,425 | 8,561 | 4,010,987 | 8,026,782 |
| 2 | カウンターパーティ信用リスク | 42,730 | 358 | 43,088 | 87,359 |
| 3 | CVAリスク | | 160,707 | 160,707 | 165,256 |
| 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 | - | 77,395 | 77,395 | 77,395 |
| 5 | マーケット・リスク | - | 332 | 332 | 332 |
| 6 | オペレーショナル・リスク | | 177,783 | 177,783 | 177,783 |
| 7 | その他リスク・アセット | | 790,380 | 790,380 | 446,324 |
| 8 | 合計 | 4,045,155 | 1,215,520 | 5,260,676 | 8,981,235 |