

| 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<br>リスク・アセットの額 | 標準的な手法適用分の<br>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、<br>標準的な手法により算出した<br>リスク・アセットの額<br>（フロア掛目前） |
| 1                                  | 信用リスク                                      | 58,206,927                  | 5,435,510                | 63,642,438 | 117,663,539                                               |
| 2                                  | カウンターパーティ信用リスク                             | 2,008,341                   | 951,718                  | 2,960,059  | 6,133,042                                                 |
| 3                                  | CVAリスク                                     |                             | 2,846,990                | 2,846,990  | 2,846,990                                                 |
| 4                                  | 信用リスク・アセットの額の算出<br>対象となっている証券化エクス<br>ポージャー | 1,337,659                   | 229,675                  | 1,567,334  | 2,429,190                                                 |
| 5                                  | マーケット・リスク                                  | —                           | 4,019,958                | 4,019,958  | 4,019,958                                                 |
| 6                                  | オペレーショナル・リスク                               |                             | 5,545,060                | 5,545,060  | 5,545,060                                                 |
| 7                                  | その他リスク・アセット                                |                             | 16,130,471               | 16,130,471 | 12,013,715                                                |
| 8                                  | 合計                                         | 61,552,928                  | 35,159,385               | 96,712,314 | 150,651,497                                               |