株式会社　名古屋銀行

■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（2026年9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	1,177,899	590,457	1,768,356	2,680,249
2	カウンターパーティ信用リスク	7,080	—	7,080	11,357
3	CVAリスク		70,449	70,449	70,449
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	—	26,813	26,813	26,813
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		76,218	76,218	76,218
7	その他リスク・アセット		198,909	198,909	169,337
8	合計	1,184,979	962,848	2,147,827	3,034,427