

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		イ	ロ	ハ	ニ
項番		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	1,936,390	9,973	1,946,363	3,046,516
2	カウンターパーティ信用リスク	26,107	929	27,036	34,057
3	CVARリスク		36,162	36,162	39,658
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	—	5,819	5,819	5,819
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		67,114	67,114	67,114
7	その他リスク・アセット		350,154	350,154	175,989
8	合計	1,962,497	470,155	2,432,652	3,369,155