

内部モデルを用いた手法と標準的手法の連結リスク・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					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		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	3,518,373	43,858	3,562,232	5,704,253
2	カウンターパーティ信用リスク	30,360	3,396	33,757	50,967
3	CVAリスク		46,088	46,088	61,857
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	16,445	7,158	23,603	42,583
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		138,138	138,138	138,138
7	その他リスク・アセット		615,271	615,271	327,431
8	合計	3,565,179	853,911	4,419,091	6,325,232