

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					
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	1,991,878	13,034	2,004,912	3,142,898
2	カウンターパーティ信用リスク	30,622	875	31,497	40,584
3	CVARリスク		31,267	31,267	33,192
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	—	5,675	5,675	5,675
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		389,880	389,880	181,515
8	合計	2,022,500	507,846	2,530,347	3,470,981