

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	3,600,672	56,938	3,657,610	5,868,858
2	カウンターパーティ信用リスク	41,213	3,336	44,550	58,394
3	CVAリスク		45,040	45,040	56,093
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	16,414	7,140	23,555	41,891
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		687,479	687,479	317,268
8	合計	3,658,301	938,075	4,596,376	6,480,645