

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	2,036,921	10,559	2,047,480	3,183,606
2	カウンターパーティ信用リスク	31,923	1,006	32,929	43,798
3	CVARリスク		38,274	38,274	50,224
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	—	5,851	5,851	5,851
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		69,124	69,124	69,124
7	その他リスク・アセット		457,040	457,040	200,787
8	合計	2,068,844	581,856	2,650,701	3,553,393