

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	3,644,593	50,408	3,695,002	5,966,445
2	カウンターパーティ信用リスク	39,953	3,465	43,419	59,753
3	CVAリスク		51,222	51,222	69,539
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	16,711	7,408	24,119	41,412
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		143,381	143,381	143,381
7	その他リスク・アセット		798,337	798,337	367,947
8	合計	3,701,257	1,054,223	4,755,481	6,648,479