

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	3,659,108	58,102	3,717,210	5,982,368
2	カウンターパーティ信用リスク	34,604	2,204	36,808	48,346
3	CVAリスク		48,696	48,696	71,041
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	16,162	7,996	24,159	41,336
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		909,920	909,920	404,616
8	合計	3,709,874	1,170,301	4,880,176	6,691,090