

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	2,080,511	89,211	2,169,722	3,319,811
2	カウンターパーティ信用リスク	26,725	796	27,521	34,358
3	CVAリスク		35,418	35,418	46,117
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	—	6,217	6,217	6,217
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		67,453	67,453	67,453
7	その他リスク・アセット		601,410	601,410	296,958
8	合計	2,107,236	800,508	2,907,744	3,770,917