

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
		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	3,653,493	184,098	3,837,591	6,120,688
2	カウンターパーティ信用リスク	34,174	2,340	36,514	48,539
3	CVAリスク		44,957	44,957	61,541
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	15,788	7,753	23,542	40,407
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		140,473	140,473	140,473
7	その他リスク・アセット		980,615	980,615	493,489
8	合計	3,703,456	1,360,239	5,063,696	6,905,139