

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
		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	2,071,102	90,929	2,162,032	3,280,354
2	カウンターパーティ信用リスク	30,350	641	30,991	38,440
3	CVAリスク		32,702	32,702	39,569
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	—	6,212	6,212	6,212
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		670,837	670,837	324,922
8	合計	2,101,453	868,776	2,970,230	3,756,953