

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	3,643,422	191,048	3,834,471	6,092,528
2	カウンターパーティ信用リスク	38,287	1,659	39,947	52,788
3	CVAリスク		45,884	45,884	58,914
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	15,466	7,937	23,403	39,983
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		1,076,145	1,076,145	539,759
8	合計	3,697,176	1,463,148	5,160,325	6,924,448