

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	1,901,171	85,226	1,986,397	3,134,901
2	カウンターパーティ信用リスク	28,331	626	28,958	34,237
3	CVAリスク		39,714	39,714	51,007
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	—	6,113	6,113	6,113
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		74,620	74,620	74,620
7	その他リスク・アセット		709,845	709,845	343,153
8	合計	1,929,502	916,147	2,845,650	3,644,032