

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	3,449,015	171,837	3,620,852	5,922,451
2	カウンターパーティ信用リスク	39,889	1,595	41,484	52,812
3	CVAリスク		52,070	52,070	74,637
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	15,252	7,270	22,522	38,560
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		151,757	151,757	151,757
7	その他リスク・アセット		1,125,370	1,125,370	564,426
8	合計	3,504,157	1,509,900	5,014,058	6,804,645