

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	3,484,737	171,526	3,656,264	5,946,434
2	カウンターパーティ信用リスク	36,174	1,835	38,009	49,658
3	CVAリスク		39,049	39,049	52,562
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	14,582	6,928	21,511	37,511
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		1,158,023	1,158,023	576,749
8	合計	3,535,494	1,529,121	5,064,615	6,814,674