

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	3,484,663	184,189	3,668,853	5,940,080
2	カウンターパーティ信用リスク	30,264	1,960	32,224	39,910
3	CVAリスク		43,282	43,282	56,776
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	14,808	8,536	23,344	38,439
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		144,328	144,328	144,328
7	その他リスク・アセット		1,146,402	1,146,402	678,539
8	合計	3,529,736	1,528,699	5,058,436	6,898,073