

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	1,801,945	100,155	1,902,101	3,109,985
2	カウンターパーティ信用リスク	23,590	656	24,247	30,928
3	CVAリスク		34,482	34,482	42,843
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	—	5,462	5,462	5,462
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		72,698	72,698	72,698
7	その他リスク・アセット		735,371	735,371	427,178
8	合計	1,825,536	948,826	2,774,362	3,689,096