

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	3,329,227	172,143	3,501,370	5,937,190
2	カウンターパーティ信用リスク	32,486	2,132	34,618	47,238
3	CVAリスク		43,735	43,735	61,993
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	14,609	7,485	22,095	36,795
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		1,148,633	1,148,633	684,205
8	合計	3,376,323	1,518,457	4,894,781	6,911,752