

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
		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	1,811,991	110,737	1,922,728
2	カウンターパーティ信用リスク	21,531	660	22,192
3	CVAリスク		31,883	31,883
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	—	6,367	6,367
5	マーケット・リスク	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		75,106	75,106
7	その他リスク・アセット		728,313	728,313
8	合計	1,833,523	953,068	2,786,591

3,719,483