

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	3,340,609	194,637	3,535,247	5,971,419
2	カウンターパーティ信用リスク	29,127	2,100	31,228	43,691
3	CVAリスク		41,944	41,944	53,795
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	14,257	9,891	24,148	38,587
5	マーケット・リスク	—	—	—	—
6	オペレーショナル・リスク		145,693	145,693	145,693
7	その他リスク・アセット		1,159,780	1,159,780	678,357
8	合計	3,383,995	1,554,048	4,938,043	6,931,545