

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	55,339,864	2,303,813	57,643,678	112,957,953
2	カウンターパーティ信用リスク	2,059,938	95,183	2,155,121	5,466,041
3	CVAリスク		2,365,147	2,365,147	2,365,147
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	1,444,783	256,635	1,701,419	2,513,919
5	マーケット・リスク	—	3,145,173	3,145,173	3,145,173
6	オペレーショナル・リスク		4,351,963	4,351,963	4,351,963
7	その他リスク・アセット		11,509,513	11,509,513	8,267,769
8	合計	58,844,586	24,027,430	82,872,017	139,067,969