

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	57,705,263	6,145,668	63,850,932	119,957,401
2	カウンターパーティ信用リスク	2,052,547	832,886	2,885,434	6,185,044
3	CVAリスク		2,780,656	2,780,656	2,780,656
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	272,991	1,717,775	2,530,274
5	マーケット・リスク		4,139,883	4,139,883	4,139,883
6	オペレーショナル・リスク		5,976,404	5,976,404	5,976,404
7	その他リスク・アセット		14,490,810	14,490,810	11,155,193
8	合計	61,202,595	34,639,300	95,841,896	152,724,859