

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	49,290,881	8,305,371	57,596,253	112,416,555
2	カウンターパーティ信用リスク	2,702,325	124,480	2,826,805	6,339,001
3	CVAリスク		2,588,598	2,588,598	2,588,598
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	2,255,248	872,358	3,127,607	4,216,599
5	マーケット・リスク		3,596,624	3,596,624	3,596,624
6	オペレーショナル・リスク		5,290,906	5,290,906	5,290,906
7	その他リスク・アセット		12,449,363	12,449,363	9,571,596
8	合計	54,248,455	33,227,703	87,476,158	144,019,882