

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	52,265,367	6,659,978	58,925,346	117,095,480
2	カウンターパーティ信用リスク	2,500,281	165,363	2,665,645	6,269,131
3	CVAリスク		2,535,829	2,535,829	2,535,829
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	1,656,541	284,585	1,941,126	2,847,133
5	マーケット・リスク		3,149,021	3,149,021	3,149,021
6	オペレーションナル・リスク		4,898,591	4,898,591	4,898,591
7	その他リスク・アセット		11,289,718	11,289,718	8,479,806
8	合計	56,422,190	28,983,089	85,405,279	145,274,994