

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	52,150,007	12,142,398	64,292,405	119,543,577
2	カウンターパーティ信用リスク	2,679,578	1,039,424	3,719,002	7,203,583
3	CVAリスク		3,086,522	3,086,522	3,086,522
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	873,079	3,128,328	4,217,320
5	マーケット・リスク		4,583,341	4,583,341	4,583,341
6	オペレーショナル・リスク		7,384,012	7,384,012	7,384,012
7	その他リスク・アセット		14,884,589	14,884,589	12,045,503
8	合計	57,084,834	43,993,367	101,078,201	158,063,860